clearstream | DEUTSCHE BÖRSE GROUP

CASCADE Handbuch Band 3

für Kunden der Clearstream Banking

(Effektiver Wertpapierbereich)

CASCADE Handbuch Band 3

Clearstream Banking AG, Frankfurt

Dokument-Nummer: F-CON04

März 2015

Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen können ohne weitere Mitteilung geändert werden und stellen keine Zusage seitens Clearstream Banking AG, Frankfurt (nachfolgend als Clearstream Banking Frankfurt oder CBF bezeichnet) oder eines anderen zu Clearstream International, société anonyme gehörenden Unternehmens dar. Ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von Clearstream Banking Frankfurt darf kein Teil des vorliegenden Handbuches zu irgendeinem Zweck in irgendeiner Form oder auf irgendeine Weise, einschließlich der Erstellung von Fotokopien und Aufzeichnungen, reproduziert oder übertragen werden.

Vorbehaltlich gegenteiliger Angabe erfolgen alle Zeitangaben in Mitteleuropäischer Zeit (MEZ).

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2013). Alle Rechte vorbehalten.

Vorwort

Dieses Benutzerhandbuch informiert den Kunden von Clearstream Banking Frankfurt (nachfolgend CBF) über die Bedienung der Online-Anwendung CASCADE-Host der CASCADE-Abwicklungsplattform. Neben der Beschreibung der Online-Funktionalitäten liefert das Benutzerhandbuch auch Hintergrundinformationen zur Wertpapierabwicklung über CASCADE.

Das Benutzerhandbuch untersteht den Allgemeinen Geschäftsbedingungen von CBF. Die im CASCADE Benutzerhandbuch enthaltenen Informationen gelten in Verbindung mit anderen CBF-Publikationen (CBF Customer Handbook, CBF Connectivity Handbook, CASCADE Links Guide), Kundeninformationen und sonstigen Benutzerhandbüchern, die weitere Details hinsichtlich der Nutzung der Serviceleistungen von CBF beschreiben. Gültig ist jeweils die aktuelle Fassung auf der Internetseite www.clearstream.com. Für Fragen zu Inhalten dieses Handbuchs wenden Sie sich bitte an Ihren Client Services Officer oder Relationship Manager.

Das CASCADE-Benutzerhandbuch ist in drei Bände aufgeteilt. Die vorliegende Dokumentation ist der dritte Band und beinhaltet die CASCADE-Funktionalitäten, wie sie für den effektiven Wertpapierbereich genutzt werden können.

Band 1

- Allgemeine Informationen zur CASCADE-Plattform und Systeminformationen zur Online-Schnittstelle
- Abwicklung von Börsengeschäft für nicht CCP (Central Counterparty) Geschäfte
- Abwicklung von OTC-Geschäft
- Abwicklung von Lieferinstruktionen des CCP
- Geldregulierung

Band 2

- Bestandsführung und Depotumsätze
- Custody Services (Income und Non Income)
- Special Services zu Namensaktien
- Special Services zu Global Securities Financing
- Reporting (Listen und Auswertungen)
- Tabellen und Schlüsselverzeichnisse
- Glossar

Band 3

- Auftragsabwicklung für Ein- und Auslieferungen
- Allgemeine Informationsdienste (z. B. Umsatzinformationen)
- Auswertungen
- Depotdisposition und Depotbuchung für Ein- und Auslieferungen
- EDT-Process
- Autodispo-Service
- Euro-Umstellung für Wertpapiere
- Glossar
- Anhänge: Tabellen und Schlüsselverzeichnisse

Leerseite

Inhalt

Vorwort

1 Zentrale Abwicklungsplattform CASCADE

2 Kontakte

2.1 Ansprechpartner 2-2

3 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen

4 Das Zugriffsschutz-System

5 Online Passwortänderung

6 An-/Abmeldung zum Online-System

6.1 Anmelden 6-1
6.2 Abmelden 6-5

7 Allgemeingültige Feldeingaberegeln

8 Tastenbelegung

9 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

10 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

10.1 Stückenummern 10-1
10.1.1 Erfassung der Stückenummern – Begriffe und Zeichensatz 10-1
10.1.2 Erfassung von Ziffern, Buchstaben und Zeichen für Stückenummerneingabe . . 10-4
10.1.3 Anzeige der Stückenummern in der Anwendung 10-4
10.1.4 Bearbeitung der erfassten Stückenummern 10-5
10.2 Die Kundenreferenz 10-7
10.2.1 Format der Kundenreferenz 10-7

11 Hauptauswahlmenü CASCADE-Auftragsabwicklung

12 Erfassung von Aufträgen (EW)

12.1 Erfassung von Aufträgen zur laufenden Einlieferung von Wertpapieren (EL) 12-3
12.1.1 Buchungsrelevante Auftragsdaten 12-3
12.1.2 Wertpapierrelevante Folgedaten 12-6
12.1.3 Folgedaten Stückenummern 12-10
12.1.4 Änderung Kennzeichen SAMMELURKUNDE (J/N) 12-15
12.2 Erfassung Neuzulassung/Valutierung (NV) 12-16
12.2.1 Berechtigungsprüfung bei Valutierung 12-16
12.2.2 Autom. Buchungsfreigabe Valutierung 12-16
12.2.3 Untertägige Tresorvereinnahmung und automatische Überleitung in den Kontrollierten CARAD Bestand 12-17
12.2.4 Neuzulassung Rahmenurkunde mit gleichzeitiger Valutierung 12-17
12.2.5 Buchungsrelevante Auftragsdaten 12-18
12.2.6 Wertpapierrelevante Folgedaten 12-23

12.2.7 Stückenummern Folgedaten 12-26
12.3 Erfassung von Aufträgen zur effektiven Auslieferung oder Revalutierung/Teilreduzierung von Emissionen (AL) 12-29
12.3.1 Berechtigungsprüfung bei Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde . 12-29
12.3.2 Autom. Buchungsfreigabe Revalutierung ohne Auslieferung 12-30
12.3.3 Buchungsrelevante Auftragsdaten 12-30
12.3.4 Folgedaten Versand 12-33
12.3.5 Stückenummern und Stückelung Folgedaten 12-34

13 Namensaktien (RS)

13.1 Allgemeines. 13-1
13.1.1 Phasenkonzept 13-1
13.1.2 Settlement-Art 13-1
13.1.3 Auftragserteilung per Datenfernübertragung (DFÜ) 13-1
13.1.4 Auseinanderfallen von technischem und fachlichem GS-Stichtag 13-1
13.1.5 Allgemeines zum KE-Typ 13-2
13.1.6 Allgemeines zur Weiterleitung KE-Typ an Aktienregister 13-2
13.1.7 Kundenanforderungen hinsichtlich der einzureichenden Urkunde 13-3
13.2 Aufträge zur lfd. Einlieferung von Namensaktien (RS) 13-4
13.2.1 Allgemeines 13-4
13.2.2 Auftragserfassung 13-7
13.2.3 Buchungsrelevante Auftragsdaten 13-8
13.2.4 Wertpapierrelevante Folgedaten 13-10
13.2.5 Zession Folgedaten 13-13
13.2.6 Stückenummern Folgedaten 13-14
13.3 Neuzulassung/Valutierung (NV) 13-15
13.3.1 Neuzulassung Globalurkunde (GS-Aufnahme/Umstellung Inhaber- in Namensaktien) 13-15
13.3.2 Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde 13-15
13.3.3 Neuzulassung Rahmenurkunde ohne Valutierung für bedingtes Kapital 13-16
13.3.4 Neuzulassung Rahmenurkunde für laufende Einlieferung von Namensaktien . . 13-17
13.3.5 Funktion Valutierung - RS 13-18
13.4 Die Auslieferung von Namensaktien (RS) nach dem GS-Stichtag 13-20

14 TEFRA D Anleihen

14.1 Einlieferung der Urkunden 14-1
14.1.1 Aufstockung des Emissionsvolumen einer TEFRA D Gattung 14-1
14.2 Umlegung nach Frist-Ablauf 14-2
14.2.1 Automatische Änderung der Einlieferungsgründe nach Ablauf der TEFRA D Frist 14-2
14.2.2 Automatische Umbuchung der CARAD Bestände über CASCADE-Auftrag AA 18 14-3
14.2.3 Manuelle Umbuchung der CARAD Bestände über CASCADE-Auftrag AA 18 nach Ablauf der TEFRA D Frist 14-3
14.2.4 Timeline TEFRA D 14-3

15 Electronical documentation transfer EDT

16 Autodispo-Service

16.1 Einführung der automat. Valutierung und Revalutierung für Zertifikate, Optionsscheine und definierte Anleihen 16-1
16.2 Prozessvoraussetzungen. 16-2

17 Änderung/Löschung (EB)

17.1 Änderung von Aufträgen 17-1
17.1.1 Änderung fehlerhafter Aufträge (AF) 17-2
17.1.2 Änderung eines Auftrages über die Auftragsnummer (AN) 17-3
17.2 Löschung von Aufträgen 17-5
17.2.1 Löschung fehlerhafter Aufträge (LF) 17-5
17.2.2 Löschung eines Auftrages über die Auftragsnummer (LN) 17-6

18 Information (EI)

19 Kontrolle (EC)

19.1 Kontrolle über die Vollanzeige 19-2
19.2 Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige. 19-5
19.2.1 Kontrollvorgänge 19-6
19.3 Automatische Löschung von Einlieferungsaufträgen im Erfassungsstatus. 19-8

20 Information (AI)

20.1 Aktuelle Aufträge (AA, AN, AD, SR). 20-2
20.2 Historische Aufträge (HA) 20-5
20.3 Information über Vollanzeige 20-6

21 Änderung/Löschung (AA)

21.1 Markierung zur Änderung (MA). 21-1
21.2 Markierung zur Löschung (ML). 21-4
21.3 Autom. Löschung von Einlieferungsaufträgen zu denen keine Stücke eingeliefert wurden 21-6
21.3.1 Systeminformationen zu Fristen (KVAV) 21-6
21.3.2 Online-Information zu den gültigen Fristen (IS) 21-6
21.3.3 Prüfung auf Fristüberschreitung 21-8
21.4 Automatische Löschung von Aufträgen bei Redenomination. 21-9

22 Belege

22.1 Der Einlieferungsauftrag. 22-1

23 Auswertungen

24 Listen aus CASCADE

24.1 CASCADE-Tageslisten Erfassungsstatus 24-2
24.1.1 Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen 24-2
24.2 CASCADE-Tageslisten Auftragsstatus 24-3
24.3 Erfassungs- und Auftragsstatus CASCADE 24-4
24.3.1 Oppositionsliste zu Einlieferungen 24-4
24.4 Weitere Auswertungen für Einlieferungen 24-5
24.4.1 Avise 24-5
24.5 Auswertungen für die Einlieferung von Namensaktien vor dem GS-Stichtag 24-6

24.6 List-Identifikation 24-7
24.6.1 CASCADE-Auftragsabwicklung 24-7
24.6.2 CASCADE-Verarbeitung 24-8
24.6.3 CASCADE-Dienste für Namensaktien (RS) 24-8

25 Depot-Disposition und Buchung

25.1 Die Auftragsarten "Einlieferung" und "Auslieferung" 25-1
25.1.1 Gesamtablauf im zeitlichen Überblick 25-1
25.2 Rückgabe von Aufträgen 25-2
25.2.1 Rückgabe von Einlieferungen 25-2
25.2.2 Rückgabe von Auslieferungen 25-2

26 Euro-Umstellung

26.1 TOP-DOWN mit Eingabe der Nominale in EURO 26-1
26.2 BOTTOM-UP mit Eingabe der Nominale in EURO 26-3
26.3 BOTTOM-UP mit Eingabe der Nominale Urkunde 26-5

Glossar

Anhang 1: Transaktionscodes und die zugehörigen Funktionscodes

Clearing und Settlement/Custody 28-1

Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse)

Anhang 3: Tabellen (Berechtigungsprüfung)

Anhang 4: Tabellen (Buchungstextschlüssel)

1 Zentrale Abwicklungsplattform CASCADE

Der Wunsch nach schneller und benutzerfreundlicher Verfügbarkeit einer Vielzahl von Abwicklungs-Dienstleistungen war der Grund für die Entwicklung von CASCADE (Central Application for Settlement, Clearing and Depository Expansion). CASCADE umfasst die Dienstleistungen Auftragserteilung und Auftragsabwicklung für den Giro- und Effektivbereich.

Zusätzlich zur Standardabwicklung (STD-Batchverarbeitung/für Informationen zu den CASCADE-Settlementzyklen siehe Band 1 des Benutzerhandbuchs, Abschnitt 1.1.2) von Wertpapieraufträgen im Effektivbereich ermöglicht CASCADE:

- Real-Time-Settlement - also die sofortige Buchung für Ein- und Auslieferung von effektiven Wertpapieren, insbesondere zur Abwicklung von Neu-Emissionen.

Mit der Erfassung von Einlieferungsaufträgen wird auf die vorgegebenen Stückenummern eine real-time Prüfung zu den von WM gelieferten Oppositionsdaten vorgenommen. Gleichzeitig wird auch gegen den zu diesem Zeitpunkt vorhandenen Stückenummernbestand im CBF-System CARAD und aller im Auftragsstatus befindlichen Einlieferungen, eine real-time Prüfung durchgeführt. Nur nach erfolgreicher Prüfung können diese Aufträge zur Kontrolle bearbeitet werden.

Auslieferungen werden direkt auf möglichen Tresorbestand geprüft.

Die konsequente Anwendung des Vier-Augen-Prinzips bei der Online Auftragserteilung vermeidet Erfassungsfehler und stellt ein wesentliches Kontrollinstrument für Qualität der erteilten Aufträge dar.

Für CASCADE Ein- und Auslieferung stehen zwei Kommunikationswege zur Verfügung:

- Online-Eingabe über Terminal/PC
- Elektronischer Datenaustausch (File Transfer)

Standardisierte Datenformate nach ISO-SWIFT ermöglichen es dem Kunden, Auftragsdaten aus dem eigenen Inhouse-System automatisiert direkt in das CASCADE-System zu leiten bzw. von dort zu erhalten.

Leerseite

2 Kontakte

Clearstream Banking

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse:
Clearstream Banking AG, Frankfurt
Mergenthalerallee 61
D - 65760 Eschborn

Postanschrift:
Clearstream Banking AG, Frankfurt
D - 60485 Frankfurt/Main

Tel: +49 (0)69 211 0
Fax: +49 (0)69 211 13701

www.clearstream.com

2.1 Ansprechpartner

Weitere Informationen erhalten Sie vom Clearstream Banking Client Services oder Ihrem Relationship Officer.

3 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen

Die Einrichtung einer Dialogverbindung erfordert folgende Maßnahmen:

Der Kunde der Clearstream Banking AG, Frankfurt (CBF) fordert einen Systemfragebogen von der Kundenbetreuung der CBF an. Dieser ist ausgefüllt an die vorgegebene Adresse zurückzusenden.

Wenn noch keine Postleitung existiert, stellt die Deutsche Börse Systems AG bei der TELEKOM einen Postleitungsantrag, der auch dem Kunden zur Unterschrift zugeht (Dauer bis zur Schaltung der Leitung: zurzeit 6-8 Wochen).

Nachdem die Postleitung geschaltet worden ist, erfolgt von der Deutsche Börse Systems AG (DBS) die Generierung der Leitung in der System-Software (Generierungsrhythmus: ca. vier Wochen).

Vom Kunden sind die gewünschten Anwendungen bei der CBF zu beantragen, d. h. aufgrund der Dialogverbindung besteht (nach Bedarf) die Möglichkeit einer universellen Nutzung aller Anwendungen (CASCADE, LION, WSS).

Die Betriebssicherheit IT der Gruppe Deutsche Börse wird davon in Kenntnis gesetzt und der Hauptsecurity-Beauftragte sendet dem Kunden den Antrag "Berechtigung zur Nutzung von Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse".

Leerseite

4 Das Zugriffsschutz-System

Mit Einführung der Datenbanksoftware 'IMS', die auch Basis für CASCADE ist, wurde gleichzeitig ein Security-System installiert, das einen weitestgehenden Schutz der IMS-Online-Anwendungen vor Missbrauch ermöglicht.

Voraussetzung für das Security-System ist eine Security-Datenbank (Benutzer-Datenbank), in der jeder Benutzer mit seinem eindeutigen Identifizierungs-Kennzeichen (ID-KZ) und Passwort sowie seinen Transaktionsberechtigungen gespeichert ist. Diese Transaktionsberechtigungen werden von dem Kunden-Security-Beauftragten den verschiedenen Mitarbeitern zugeordnet.

In jeder Bank müssen zwei Security-Beauftragte benannt sein, die sich in ihren Aufgabenbereichen folgendermaßen unterscheiden:

- Der Bank Security-Beautragte zur Pflege
  Aufgaben: Pflegen der Berechtigungsdaten in der Security-Datenbank, d. h. Funktionscodeberechtigungen können erfasst, geändert, gelöscht sowie angezeigt werden.
- Der Bank Security-Beautragte zur Freigabe
  Aufgaben: Kontrolle und Freigabe der Anwendungsberechtigungen, die der Kunden-Security Beauftragte zur Pflege vergeben hat.

Im Folgenden wird der Aufbau des Mitarbeiter-Security-Daten-Formulars erläutert, das Sie von Ihrem “Security-Beauftragten” erhalten haben. Hier wird Ihnen mitgeteilt, für welche Transaktionen und Funktionen von CASCADE (oder von anderen IMS-Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse) Ihnen eine Zugriffsberechtigung zugewiesen worden ist.

Im oberen Teil des Formulars wird neben dem User-Identifizierungskennzeichen, dem Namen und Vornamen der zugriffsberechtigten Person auch das Ersterfassungs-Passwort angegeben. Dieses Passwort wird beim Ersteinstieg in das System vom User im Online-Passwortänderungsdienst in ein eigenes Passwort umgeändert. Außerdem wird der Status “Ersterfassung”, “Änderung” oder “Löschung” aufgeführt.

Im unteren Teil des Formulars können drei Transaktionscodes zugeteilt werden.

Für weitere Transaktionscodes müssen zusätzliche Blätter ausgefüllt werden. Insgesamt stehen pro Transaktionscode 100 Stellen zur Verfügung:

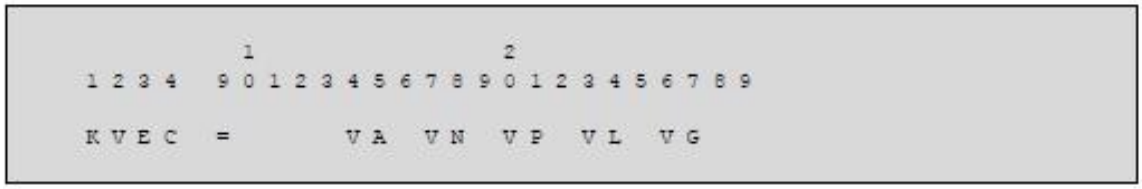
- Stelle 1-4: 4-stelliger Transaktionscode
- Stelle 9-10: hier kann angegeben werden, ob der Mitarbeiter für einen Funktionscode zugelassen ist ("=" --> positiv Steuerung) oder nicht ("/=" bzw. "=/" --> negativ Steuerung)
- Stelle 11-12: leer
- Stelle 13: Angabe des Tresors (CBF-intern)
- Stelle 14-100: Angabe von 2-stelligen Funktionscodes zu einem Transaktionscode, die durch eine Leerstelle voneinander getrennt sein müssen.

Beispiele:

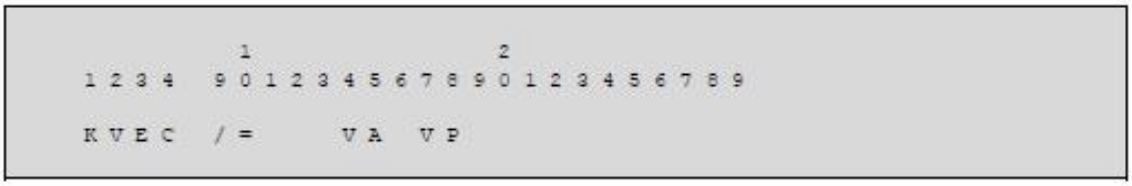
Für den Transaktionscode “KVEC” existieren folgende Funktionscodes:

“VA”, “VN”, “VP”, “VL”, “VG”, “TA”, “TN”, “TP”, “TL”, “TG”.

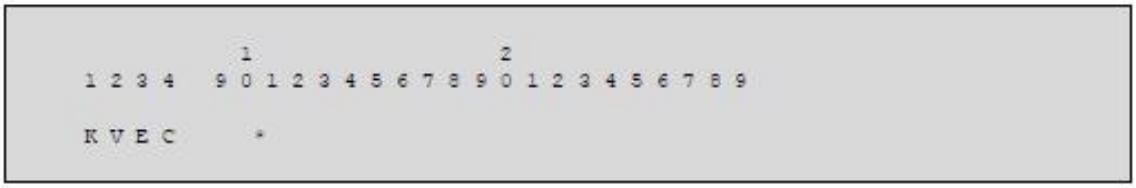
1. Der Anwender soll beim Transaktionscode “KVEC” die Zugriffsberechtigung für die Funktionscodes “VA”, “VN”, “VP”, “VL” und “VG” erhalten.



2. Der Anwender erhält beim Transaktionscode “KVEC” die Zugriffsberechtigung für alle Funktionscodes außer “VA” und “VP”.



3. Der Anwender erhält beim Transaktionscode “KVEC” die Zugriffsberechtigung für alle Funktionscodes.



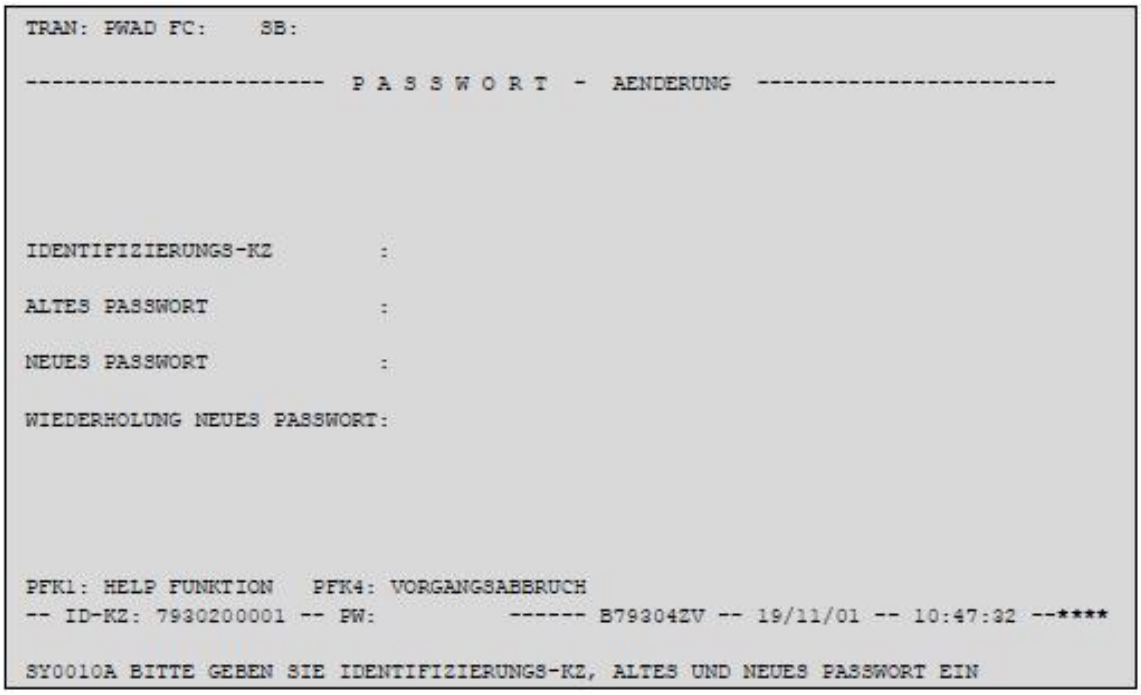
* Keine Eingaben

5 Online Passwortänderung

Mit Hilfe dieser Funktion kann die Änderung eines Passwortes durchgeführt werden:

Transaktionscode “MENU” (1. Zeile) durch “PWAD” überschreiben.

Als Ergebnis erscheint das Passwortänderungs-Menü:


TRAN: PWAD FC: SB:
P A S S W O R T - AENDERUNG
IDENTIFIZIERUNGS-KZ :
ALTES PASSWORT :
NEUES PASSWORT :
WIEDERHOLUNG NEUES PASSWORT:
PFK1: HELP FUNKTION PFK4: VORGANGSABBRUCH
-- ID-KZ: 7930200001 -- PW: ------ B79304ZV -- 19/11/01 -- 10:47:32 --****
SY0010A BITTE GEBEN SIE IDENTIFIZIERUNGS-KZ, ALTES UND NEUES PASSWORT EIN

**** Nur Musterdaten

Folgende Eingaben sind notwendig:

- Identifizierungskennzeichen
- Altes Passwort
- Neues Passwort
- Wiederholung des neuen Passwortes.

Hinweis:

Ein Passwort muss 8-stellig sein und kann aus den Zeichen “A” bis “Z” bzw. “0” bis “9” bestehen.

Werden die Daten korrekt eingegeben, wird die Passwortänderung durch eine Bildschirm-Meldung bestätigt.

Grundsätzlich kann eine Passwortänderung zu jedem Zeitpunkt vorgenommen werden. Darüber hinaus wird in folgenden Fällen automatisch der Passwortänderungsdienst aufgerufen:

Zur Änderung des Ersterfassungs-Passwortes

- muss das vom Bank-Security-Beauftragten erhaltene Erst-Passwort vor Nutzung des Systems geändert werden.

Bei Ablauf des Passwort-Gültigkeitszeitraumes

- Der Gültigkeitszeitraum eines Passwortes beträgt drei Monate, d. h. im Abstand von drei Monaten muss das Passwort geändert werden.

Durch Drücken der PF4-Taste kann der Passwortänderungsdienst abgebrochen werden.

Informationen zur Passwortänderung können durch Betätigen der PF1-Taste abgerufen werden.

Leerseite

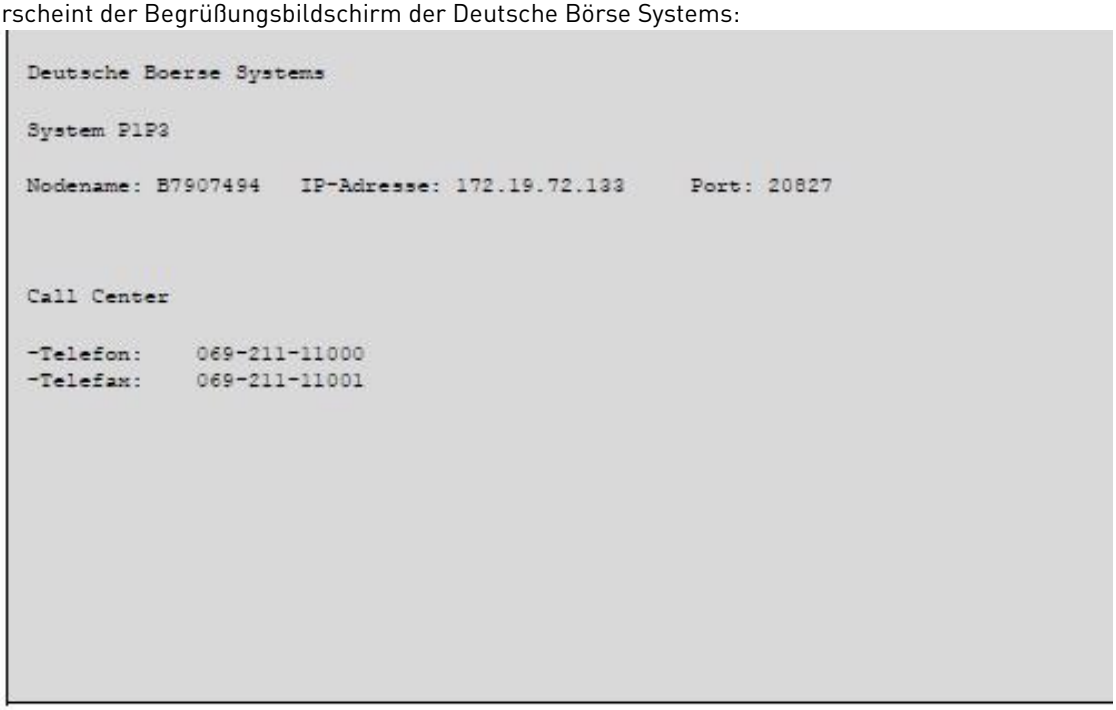
6 An-/Abmeldung zum Online-System

6.1 Anmelden

Vorgehensweise beim Aufruf von CASCADE:

- Gerät einschalten.

Es erscheint der Begrüßungsbildschirm der Deutsche Börse Systems:



- IMS1 eingeben und Datenfreigabetaste betätigen.

Als Ergebnis wird das Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse eingeblendet:

```
TRAN: MENU FC:     SB:



                              G r u p p e   D e u t s c h e   B o e r s e


Anwendungen stehen Ihnen aus folgenden Bereichen zur Verfuegung:

AK:  Clearstream Banking AG, Frankfurt   KS:  Clearstream Banking AG, Frankfurt
     International                             Domestic

BI:  XONTRO                              TR:  TRICE Meldewesen § 9 WpHG

WS:  Wertpapier - Service - System       EK:  Engagementkontrolle

BS:  Bank fuer Wertpapierservice         SO:  Sonstige Dienstleistungen
     und -systeme Aktiengesellschaft

Verlassen IMS: TRAN=/RCL + evtl. vorh. Daten in FC, SB, ID-KZ, PW loeschen

-- ID-KZ: 7930200001 -- PW:          ------ B79304ZV -- 19/11/01 -- 07:47:32 --

SY0043A BITTE DATEN EINGEBEN
```

- In der ersten Zeile im Feld "FC" das Kürzel "KS" für Anwendungen der Clearstream Banking, Frankfurt -Domestic eingeben
- In der vorletzten Zeile das ID-KZ (10-stelliges, numerisches, persönliches Identifizierungs-Kennzeichen) und Passwort eingeben.
- Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das Auswahlmenü der Clearstream Banking, Frankfurt Domestic Anwendungen:

```
TRAN: MENU FC:     SB:



          C l e a r s t r e a m   B a n k i n g ,   F r a n k f u r t


Funktionsangebot fuer Clearstream Banking, Frankfurt - Domestic

CA:  CASCADE - Auftragsabwicklung WP     CE:  CARAD - Emissionsueberwachung

CG:  CASCADE - Auftragsabwicklung GELD   CP:  CARAD - Pruefstellen

CK:  CASCADE - Dienste                   CD:  CARAD - Stueckenummernverwaltung

CR:  CASCADE - Dienste Namensaktien      KU:  Kundenstammdaten

KA:  Kapitaldienste                      EO:  Allgemeine Dienste


-- ID-KZ: 7999230003 -- PW:          ------ B7907495 -- 19/05/04 -- 13:57:25 --

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

(A) CASCADE Auftragsabwicklung

- Das Feld "FC" in der ersten Zeile mit "CA" für CASCADE füllen.
- Datenfreigabe (ENTER).

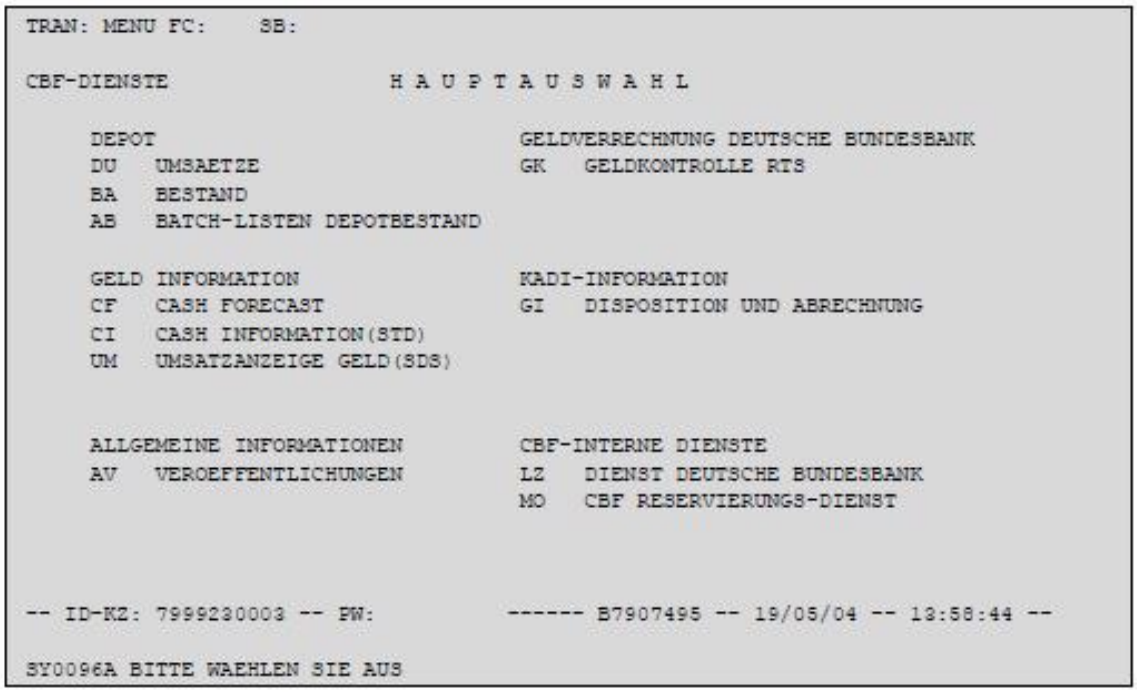
Es erscheint das CASCADE Hauptauswahlmenü:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

       ERFASSUNGSSTATUS                      AUFTRAGSSTATUS

       EE   ERFASSUNG GIROBEREICH BANK       AM   MATCH-DIENST
       EW   ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK      AS   SETTLEMENT-DIENST
       ED   ERFASSUNG CBF                    AI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EA   AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.     AA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       EB   AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.    AR   RESERVIERUNGS-DIENST
       EI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EK   KONTROLLE GIROBEREICH
       EC   KONTROLLE WERTEBEREICH           DISPOSITIONSSTATUS

       BOERSENGESCHAEFTSABWICKLUNG           DI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK

       LS   SETTLEMENT BEARBEITUNG           NACHRICHTENABWICKLUNG
       LA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       LI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK         NI   INFORMATION

-- ID-KZ: 7999230003 -- PW:          ------ B7907495 -- 19/05/04 -- 13:58:19 --

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

(B) CASCADE-Dienste (CBF-Dienste)

- Das Feld "FC" in der ersten Zeile mit "CK" für CASCADE - Dienste füllen.
- Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE-Dienste (CBF-Dienste) Hauptauswahlmenü:

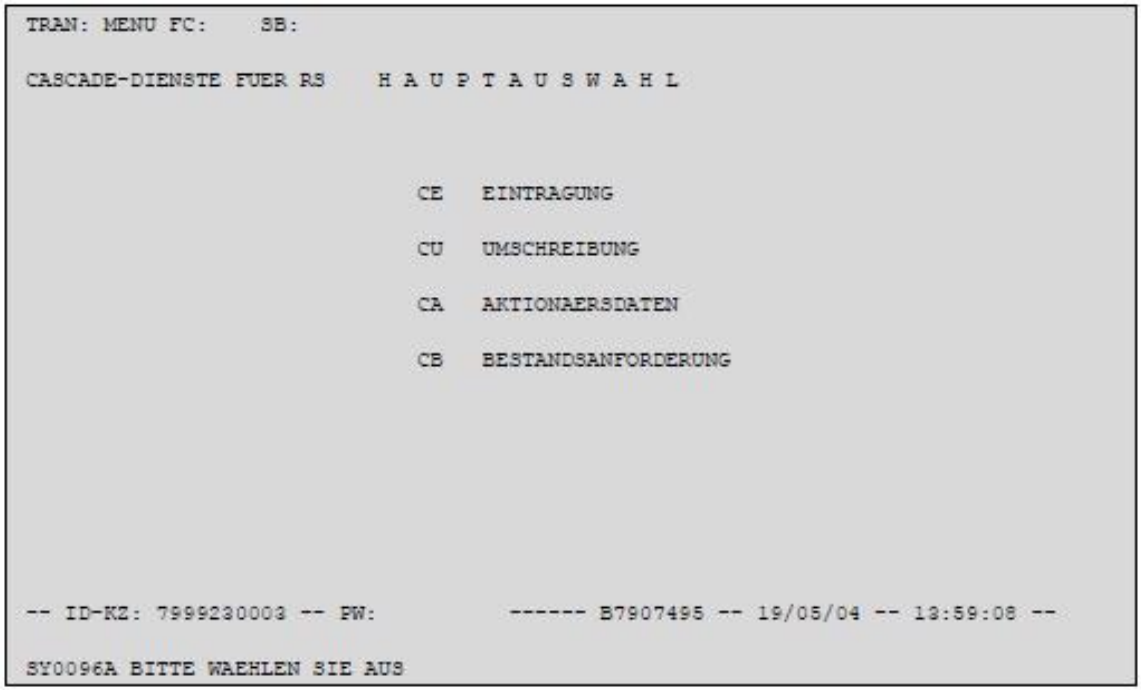


Sie können nun den Funktionscode der gewählten Anwendung eingeben (z.B. "DU" für die Depot-Umsatzanzeige).

(C) CASCADE - Dienste für Namensaktien (RS):

- Das Feld "FC" in der ersten Zeile mit "CR" für CASCADE-Dienste für RS füllen.
- Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE-Dienste für RS Hauptauswahlmenü:


TRAN: MENU FC: SB:
CASCADE-DIENSTE FUER RS H A U P T A U S W A H L
CE EINTRAGUNG
CU UMSCHREIBUNG
CA AKTIONAERSDATEN
CB BESTANDSANFORDERUNG
-- ID-KZ: 7999230003 -- PW: ------ B7907495 -- 19/05/04 -- 13:59:08 --
SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS

6.2 Abmelden

Und so können Sie sich aus der Anwendung “abmelden”:

Rückkehr vom CASCADE Hauptauswahlmenü zum Einstiegsmenü der Deutsche Börse Systems durch Betätigen der Taste PF11.

Es erscheint das Einstiegsmenü der Deutsche Börse Systems.

Im Einstiegsmenü ist der Transaktionscode “MENU” (siehe das Feld TRAN:) durch “/RCL” zu überschreiben.

Datenfreigabe betätigen.

Das erfolgreiche Verlassen des Systems wird durch das Erscheinen des Begrüßungsbildschirms der Deutsche Börse Systems dokumentiert.

Einen Hinweis zum Verlassen des Online-Systems IMS finden Sie immer in der Zeile 20 auf dem Einstiegsmenü der Deutsche Börse Systems.

Leerseite

7 Allgemeingültige Feldeingaberegeln

(A) Allgemeine Eingabeformen

Falls eine Eingabe nicht die maximale Anzahl von Stellen umfasst, die für dieses Feld vom Programm zugelassen ist, kann die Eingabe wahlweise linksbündig, rechtsbündig oder in der Mitte des Feldes erfolgen. Jede Eingabeform wird vom Programm verarbeitungsgerecht aufbereitet (numerische Felder = rechtsbündig, alphanumerische Felder = linksbündig).

(B) Numerische Eingaben

Die Eingabe führender Nullen bei den Vorkommastellen und abschließender Nullen bei den Nachkommastellen ist möglich, aber nicht erforderlich. Die Eingabe des Kommas ist nur erforderlich, wenn Nachkommastellen eingegeben werden. Bei der Eingabe von Nachkommastellen ist die Eingabe mindestens einer Stelle vor dem Komma erforderlich, ggf. einer "0".

Beispiel:

0,11	richtig
,11	falsch

(C) Datumseingaben:

Folgende Datumseingaben werden akzeptiert:

TTMM:	2011
TT.MM:	20.11
TTMMJJ:	201102
TT.M.JJ:	20.11.02
TT.MM.JJ:	20.11.02
TTMMJJJJ:	20112002
TT.MM.JJJJ:	20.11.2002

Von der Anwendung wird das eingegebene Datum in der Form "TT.MM.JJJJ" aufbereitet.

(D) Änderung eines Feldinhaltes

Die Änderung eines angezeigten Feldinhaltes ist durch Überschreiben möglich. Nicht überschriebene Stellen der Anzeige müssen gelöscht werden.

(E) Löschung eines Feldinhaltes

Zur Löschung eines angezeigten Feldinhaltes existieren folgende Möglichkeiten:

- den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste "ENDE" ("END") betätigen (Löschung des gesamten Feldes),
- den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste "ENTF" ("DEL") betätigen (Löschung Zeichen für Zeichen).

(F) Anzeige Fehlermeldungen

Bei fehlerhaften Feldeingaben werden in der Zeile 24 auf Ihrem Bildschirm Fehlermeldungen angezeigt.

Leerseite

8 Tastenbelegung

Taste	Erklärung
ENTER bzw. Datenfreigabe	(1) Auswahlmenümasken: Prüfung der Eingaben; sind die Eingaben korrekt, wird in die nächste Ebene verzweigt. Erfassungsmaske: Prüfung der Eingaben. Tabellarische Anzeigemasken: Prüfung der Eingaben. Mit der Eingabe im Feld KZ = "I" und ENTER wird in die Vollanzeige des gekennzeichneten Auftrages verzweigt.
Tabulatortaste	Vor-/Rückwärtsspringen auf das nächste eingabefähige Feld.
PF1	Führt in verschiedenen Transaktionen zur Anzeige einer Hilfemaske.
PF2	Führt zu einem Online Druck aus der Informationsvollanzeige heraus. Weiterhin kann im Rahmen der tabellarischen Kurzanzeige der Transaktion KVAI ein Online Druck mit PF2 und durch Kennzeichnung mit "D" in der KZ Spalte vorgenommen werden. Wird die Kennzeichnung mit "S" eingegeben kann ein Einlieferungsbeleg Online ausgedruckt werden. Zusätzlich kann aus der tabellarischen Anzeige der Transaktion "KVAV" ein Online-Druck aktiviert werden. (Voraussetzung für den Ausdruck ist eine leitungsbezogene Bildschirmzuordnung zum Drucker).
PF3	Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten (= Eingabebestätigung).
PF4	Mit PF4 wird ein Dialog ohne Verarbeitung abgebrochen. Anschließend wird das jeweilige Auswahlmenü angezeigt.
PF5	Nur bei tabellarischen Anzeigen, wenn aufgrund einer Zeitüberschreitung die Datenbanksuche abgebrochen werden musste; PF5 initiiert somit ein Weitersuchen nach Aufträgen in der Datenbank.
PF6	Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten und blättert gleichzeitig innerhalb eines Vorganges bei bestimmten CASCADE-Auftragsarten vor.
PF7	Ermöglicht ein Zurückblättern zur vorangegangenen Maske innerhalb eines Vorganges. Voraussetzung ist jedoch, dass innerhalb eines Maskentyps Folgemasken existieren. Infolgedessen funktioniert PF7 erst dann, wenn zuvor mit PF8 vorwärts geblättert werden konnte.
PF8	Ermöglicht ein Vorwärtsblättern zur Folgemaske innerhalb eines Vorganges (Voraussetzungen siehe PF7).
PF9	Nicht belegt.

Taste	Erklärung
PF10	Nicht belegt.
PF11	Wie bei PF4 erfolgt ein Abbruch des Dialogs ohne Verarbeitung; bewirkt zusätzlich die Abmeldung vom System CASCADE und den Rücksprung in das Gruppe Deutsche Börse-Einstiegsmenü.
PF12	Nicht belegt.

9 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
AA AUFTRAGSART	Auftragsart	2-stellig numerisch	[a]	Numerisches Kennzeichen für eine Auftragsart Folgende Ausprägungen stehen für den effektiven Wertpapierbereich zur Verfügung: 16 = Einlieferung 18 = Auslieferung
ABWEICHENDE BEZEICHNUNG	Abweichende Bezeichnung	3-stellig numerisch	muss	Existieren zu einer Stückelung gleiche Stückenummern, z. B. aufgrund einer Fusion, muss zur weiteren Identifizierung diese Angabe eingetragen werden. Die Eingabe erfolgt über einen Schlüssel. Das Feld wird immer mit 0 (keine abweichende Gattungsbezeichnung) vorbelegt. Andere Ausprägungen können bei CBF erfragt werden.
ABW. VERSANDADRESSE	Abweichende Versandadresse	1-stellig alphanumerisch	muss	Folgemaske wird aufgerufen, wenn an Dritte ausgeliefert werden soll. Vorbelegung; "N" = Nein
ADRESSE	Adresse	70-stellig alphanumerisch	kann	Bei Aufträgen zu Einlieferungen wird hier die Adresse von Dritten (z. B. Drittbank) eingegeben, für die der Kunde der CBF einliefert.
AKTIONÄRSNUMMER	Aktionärs-Nummer	10-stellig alphanum.	muss	Hier wird die Aktionärsnummer bei Namensaktien eingegeben, die physisch auf der Zession steht. Bei fehlender Aktionärsnummer muss der Eingeber außerhalb des Systems über den Emittenten die Information anfordern.
AN ADRESS-NR	Interne Nummer zur Versandadresse der CBF	numerisch	kann	Versand der Urkunden erfolgt an eine Drittbank (Vereinbarung mit der CBF notwendig)
ANZ-STKE	Anzahl Stücke	9-stellig numerisch	keine	Anzahl Urkunden pro Stückelung

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
ANZ-URKUNDEN	Anzahl Urkunden	9-stellig numerisch	keine	Anzahl Urkunden pro Stückelung
AUFTRNR AUFTRAGSNR AUFTNR A-NR	Auftragsnummer	1-7-stellig numerisch	muss	Eindeutigkeit je Eingeber muss systemseitig vorliegen. Von den Systemnutzern kann eine 7-stellige Nummer zwischen 1 und 6999999 frei vergeben werden. WP-Überträge, die automatisch in CASCADE erzeugt wurden, erhalten vom System eine eigene Nummer zwischen 9500000 und 9999999 zugewiesen. Automatisch generierte Aufträge aus Umlegungen und Stornos erhalten Auftragsnummern zwischen 8000000 und 9499999.
AUFTRAGSNR	Auftragsnummer	11-stellig numerisch (teilweise)	[a]	Umsatzanzeige: Stellen 1-4: Eingeber Stellen 5-11: Auftragsnummer
AUSG-NR	Ausgangsbuch-Nummer	6-stellig numerisch	keine	Interne fortlaufende CBF-Nummer. Wird bei der ersten Überleitung zur Disposition/ Buchung eines Auslieferungsauftrages technisch vergeben.
AUSLIEFERUNG RU	Auslieferung Rahmenurkunde	1-stellig alphanumerisch J oder N	muss	Auslieferung einer Rahmenurkunde Mögliche Eingaben: "J" = Ja "N" = Nein Vorbelegung: "N"
AUSLIEF-VERF	Auslieferungs-Verfahren	1-stellig numerisch, Textanzeige 15-stellig alphanumerisch	muss	Folgende Auslieferungsverfahren können die Kunden mit CBF vereinbaren: 1 = per Bankbote 2 = per Container 3 = per Wertpost 4 = DHL 5 = Brinks Wertransport 6 = Auslieferung w/KADI 7 = Vernichtung

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
AUSLIEF-VORG	Auslieferungs-vorgang	1-stellig numerisch	muss	Mögliche Eingaben: 1 = Auslieferung 2 = Revalutierung 3 = Teilreduzierung 5 = Revalutierung mit Reduzierung der Rahmennominale Vorbelegung: 1 = Auslieferung
BANK	Siehe Last-/Gut-Bank			
BANK-NUMMER	Bank-Nummer	4-stellig numerisch	muss	Ortskennzeichen und Hauptkontonummer
BEARB-STATUS	Bearbeitungs-status Einlieferung	3-stellig numerisch	keine	Hier wird mit einem Kennzeichen der aktuelle Bearbeitungsstatus der Einlieferung bei der CBF ausgewiesen. (Siehe Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse) "BEARBEITUNGSSTATUS EINLIEFERUNG")
BEARB-STATUS	Bearbeitungs-status Auslieferung	3-stellig numerisch	keine	Hier wird mit einem Kennzeichen der aktuelle Erfassungsstand der Bank und nach Kontrolle durch die Bank der Bearbeitungsstand der Auslieferung bei der CBF ausgewiesen. (Siehe Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse) "BEARBEITUNGSSTATUS AUSLIEFERUNG")
BEGIN-DATUM-KE DATUM-KE	Ex-Tag oder Ausübungs-datum	TT.MM.JJJJ	muss bei RS	Bei Valutierung eines Optionsscheins: BEGIN-DATUM-KE = Start Optionsfrist und DATUM-KE = tatsächlicher Ausübungstag
BESONDERHEIT	Besonderheit	3-stellig numerisch		Diese Eingabe wird erforderlich bei einer abweichenden internen Verwahrmöglichkeit zur WKN/ISIN (siehe Anhang 2 - Schlüsselverzeichnis "Besonderheiten")
BIC-CODE	BIC-Code	11-stellig alphanumerisch	kann	BIC-Code-Angabe dient zur autom. Ermittlung der Adressinformationen. (noch nicht aktiv)

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
BUCHUNGS-NOMINALE	Buchungs-Nominale	10,3-stellig numerisch	kann, Zusatz-auswahl	Nominalbetrag aus Auftrag
BUCHUNGSVALUTA BUCH-VAL	Buchungs-Valuta	10-stellig alphanumerisch	kann, Zusatz-auswahl	Datum, zu dem der Auftrag gebucht wurde.
DEPOTBUCH-BESTAND	Depotbuch-Bestand	15,3-stellig numerisch	keine	Depotbestand pro WKN/ISIN und KONTO (mit Mitbesitzübergang)
EING-NR	Eingangsbuch-Nummer	7-stellig numerisch	keine	Interne fortlaufende Nummer für das Eingangsbuch der CBF (jährliche bei Eins beginnende Perforationsnummer). Die Nummer wird je Einlieferungsposten bei der Annahme der Einlieferung automatisch durch das System vergeben.
EINHEIT EINH	Einheit	2-stellig	keine	Depotwährung (z.B. "ST", "DEM", "EUR" alphanum.)
EINLIEF-ART	Einlieferungs-Art	1-stellig numerisch	muss (DFÜ)	Spezifiziert die jeweilige laufende Einlieferung. Derzeit stehen zur Verfügung: 1 = Einlieferung 2 = Neuzulassung Globalurkunde 3 = Neuzulassung Rahmenurkunde 4 = Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde 5 = Valutierung
EINLIEFERUNG VON NAME	Einlieferung von Name	35-stellig alphanumerisch	kann	Beinhaltet den Namen von Dritten (Banken, Filialen, etc.), die nicht Kontoinhaber bei der CBF sind und deshalb über einen anderen Kunden eine Einlieferung an die CBF tätigen. Beispielsweise eine Sparkasse, die mit USER-ID einer Landesbank arbeiten darf. Handelt es sich um internationale Clearingpartner, wird die zugehörige Kurzbezeichnung automatisch hinzugefügt

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
EINLIEF-GRUND	Einlieferungs-grund	3-stellig numerisch	muss	Kennzeichnet den jeweiligen Einlieferungsgrund bei Neuzulassung und Valutierung. Derzeit stehen zur Verfügung: 001 = aus Emission 002 = Barbezug – unbedingte Kapitalerhöhung (KE) 003 = Kapitalerhöhung bedingt – Optionsscheinausübung 004 = Rahmenurkunden Ersteinlieferung RS 005 = Urkundenumtausch 007 = Gratisaktien 008 = Sperre, Revalutierung möglich
ERFASSER	Erfasser	4-stellig numerisch	muss	Über das Feld wird festgelegt, wer die Listanforderung bearbeitet. Das Feld wird vorbelegt mit den ersten 4 Stellen des ID-Kennzeichens
E E/O	Ersatzurkunde	1-stellig alphanum.	kann	Kennzeichnet eine Stückenummer als Ersatzurkunde (E)
EX-TAG/BEGIN	Ex-Tag Beginn Options-ausübung		muss bei RS	Neuzulassung/Valutierung bei Namensaktien aus Kapitalmaßnahmen
FC	Funktions-Code	2-stellig	muss	Auswahl einer Funktion
GES-NOM	Gesamtnominale	10,3-stellig numerisch	keine	Ergibt sich aus der Summe der Stückelung mal den Anzahl Stücke je Stückelung und entspricht der einzuliefernden Nominale
GRUNDEINHEIT	Grundeinheit der WKN/ISIN	9,7-stellig numerisch	keine	Wird automatisch vom System über den "Nennwert zum Stück" zugesteuert
GUT-BANK Einlieferung	Gutschrift-Bank	4-stellig numerisch	muss	Bank-Nummer des Kunden bei CBF (= Habenkonto)
GUT-KTO Auslieferung	Gutschrift-Konto	7-stellig numerisch		CBF interne Kontonummer für die Tresorbestands-führung Vorbelegung bei Eingabe, keine Änderung durch Kunden möglich

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
GUT-KTO Einlieferung	Gutschrift-Konto	7-stellig numerisch	muss	Dieses Feld beinhaltet bei einer Einlieferung die Kontonummer des Kreditinstitutes, dem der Umsatz gutgeschrieben werden soll. Der Inhalt wird mit der User-ID und der Hauptkontonummer vorbelegt
HINWEISTEXT	Hinweistext	420-stellig, alphanumerisch	keine	Internes CBF Feld. Anzeige aus CBF Adressendatenbank (KUSTA) für Effekten-Ausgang.
HINWEISTEXT (Auslieferung)	Hinweise	5 x 35-stellig alphanum.	kann	Der Auftraggeber kann hier allgemeine Hinweise zur dieser Auslieferung eintragen.
HLG	Hinterlegungsart CBF	2-stellig numerisch	muss	Mögliche Hinterlegungsarten: 01 = Girosammel-verwahrung 03 = GS Vorratslager-Bank 10 = Haussammel-verwahrung 20 = Lagerstelle 22 = Treuhand CBF 30 = Fremdtresor 40 = Edelmetall 41 = Edelmetall SD 92 = Dokumenten-verwaltung 99 = GS vorgesehen (für RS vor dem GS-Stichtag) Vorbelegung: 01 = Girosammel-verwahrung
ID AENDERUNG ID-LOESCHUNG	Identifizierungskennzeichen zur Änderung bzw. Löschung	10-stellig numerisch	keine	User-ID des Benutzers, der einen Auftrag zur Änderung bzw. zur Löschung markiert hat.
KE-TYP	Kapitalerhöhungstyp			Sammelbezeichnung für die Eingabefelder WKN DES RECHTS und EXTAG/BEGINN bei Neuzulassungen/ Aufstockung und zusätzlich DATUM-KE bei Valutierung von Kapitalerhöhungsmaßnahmen in Namensaktien (RS)
KONTO	Konto (Vorgang ab)	7-stellig numerisch	muss	Siehe LAST-/GUT-KTO

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
KONTROLL-KENNZEICHEN	Kontroll-Kennzeichen	1-stellig alphanum.	muss	Dieses Feld ist in der Funktion "Kontrolle" zu füllen. Die verschiedenen eingebbaren Kennzeichen finden Sie im Kapitel Kontrolle (EC) auf Seite 19-1.
KUNDENREFERENZ	Kundenreferenz	3-stellig alphanumerisch, 11-stellig alphanumerisch, 3-stellig alphanumerisch, 13-stellig alphanumerisch, 2-stellig numerisch,	[a]	In diesen Feld können Informationen zum Auftraggeber spezifiziert werden. Bei Einlieferung von RS identifiziert die Kundenreferenz Institut und Depotnummer für Übernahme in den Hauptbestand.
KZ	Kennzeichen-spalte	1-stellig alphanum.	kann	Zu den verschiedenen eingebbaren Kennzeichen siehe die Vorgänge in den einzelnen Kapiteln.
KZ-BST	Kennzeichen Bestand	2-stellig alphanum.	[a]	In diesem Feld wird für die Einlieferung von Namensaktien (RS) die Bestandsart, in die die Einlieferungen gebucht werden sollen, benannt. FM = Freier Meldebestand HB = Hauptbestand Vorbelegung: "HB" = Hauptbestand'
L/G	Lastschrift/ Gutschrift	L/G	keine	Anzeige eines Last- oder Gutschriftauftrages
LAND/PLZ/ORT	Land Postleitzahl Ort	3-stellig alphanumerisch, 5-stellig alphanumerisch, 30-stellig alpha-num.	kann kann kann	Adresse des Empfängers (manuelle Eingabe)
LAND/PLZ/ORT	Land Postleitzahl Ort	3-stellig alphanumerisch, 5-stellig alphanumerisch, 30-stellig alphanum.	keine	Internes CBF Feld. Adresse des Empfängers aus CBF Adressendatenbank (KUSTA) für Effekten-Ausgang
LAND/PLZ/ORT POSTFACH STRASSE (Auslieferung)	Strasse Postfach Länderkennzeichen Postleitzahl Ort	Alphanum.	kann	Angaben zur drittbegünstigten Bank für den Empfänger der Stücke

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
LAST-BANK	Lastschrift-Bank	4-stellig numerisch	a	Banknummer des Auftraggebers bei CBF (= Sollkonto)
LAST-BANK	Lastschrift-Bank	4-stellig numerisch	muss	Dieses Feld beinhaltet die Kontostammnummer der Bank, der bestimmte Vorgänge zugeordnet werden.
LAST-KONTO Auslieferung	Last-Konto	7-stellig numerisch	muss	Kundenkonto-Vorbelegung durch User-ID des Eingebers.
LAST-KONTO Einlieferung	Lastschrift-Konto	7-stellig numerisch		Internes CBF-Feld. Der Inhalt wird vorbelegt und kann nur von CBF geändert werden.
LETZTE AEND AM	letzte Änderung am	10-stellig alphanum.	keine	Datum der letzten Änderung
LETZTE AEND	Letzte Änderung von	10-stellig numerisch	keine	USER-ID des Anwenders, welcher den Auftrag zuletzt bearbeitet hat.
LETZTER KUPON	Letzter Kupon	10-stellig TT.MM.JJ oder 3-stellig alphanum.	keine	Sammelbezeichnung für den letzten zu einem Wertpapier gehörenden Ertrags-, Dividenden- oder Zinsschein bzw. Talon.
LETZTER LEG. SCHEIN/ OPTIONS-SCHEINE	Letzter Legitimations-schein/ Optionsscheine	2-stellig alphanum.	keine	Sammelbezeichnung für den letzten zu einem Wertpapier gehörenden Ertrags-, Dividenden- oder Zinsschein bzw. Talon.
MANGEL MAN M	Mangel	3-stellig numerisch 1.Stelle Tresor M/B/U 2.Stelle Mangel-ausprägung A	kann	Spezifiziert den Mangel eines Wertpapieres und benennt Oppositionsgründe. Bei Ersteinlieferungen für Namensaktien werden hier auch Abweichungen in den Daten Aktionärsnummer/ Stückenummer zum Aktienbuch des Emittenten ausgewiesen. Schlüsseltabellen für die verschiedenen Mängel (Schlüssel ab 50) und Oppositionsgründe (Schlüssel 0 bis 49) siehe Anhang Mangel auf Seite -7.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
NACHWEISART	Nachweisart	2-stellig numerisch	muss	Kennzeichen, wie die zum Einlieferungsauftrag gehörenden Urkunden bei der CBF eingereicht werden. Folgende Ausprägungen sind möglich: 01 = Einlieferung effektiver Urkunden 02 = Urkunden liegen bereits vor 03 = Urkunden von Druckerei 04 = Einlieferung ohne Urkunden (mit Rahmenvertrag) (nur für Namensaktien-RS) 05 = Einlieferung mit Urkunden (nur für RS) 06 = Um-/Festschreibung 07 = Zession fehlt 08 = Einlieferung EDT 09 = Edelmetall
NAECHSTER KUPON	Nächster Kupon	10- oder 3- stellig numerisch	[a]	Sammelbezeichnung für den nächsten zu einem Wertpapier gehörenden Ertrags-, Dividenden- oder Zinsschein bzw. Talon (nicht bei nur im Mantel verbriefte Anleihen).
NAECHSTER LEGSCHEIN	Nächster Legitimations-schein	2-stellig alphanum.	[a]	Das Kennzeichen für den nächsten Legitimationsschein (bei Optionsscheinen)
NAME (Auslieferung)	Name	70-stellig alphanum.	[a]	Name des Empfängers (manuelle Eingabe)
NAME (Auslieferung)	Name	70-stellig alphanum.	keine	Name des Empfängers. Anzeige aus CBF Adressendatenbank (KUSTA) für Effekten-Ausgang.
NAME (Einlieferung)	Name	70-stellig alphanum.	[a]	Hier werden der Name und Wohnort des Aktionärs gemäß Aktienbuch des Emittenten angezeigt.
NAME (Auslieferung) NAMENSZUSATZ	Name Ergänzungen zu Name	70-stellig alphanum. 35-stellig alphanum.	kann kann	Hier kann der Name der drittbegünstigten Bank zum Direktversand der Urkunden eingegeben werden (Vertrag mit CBF erforderlich).
NOMINALE	Nominale	10,3-stellig numerisch	muss [b]	Dieses Feld enthält den zu buchenden gesamten Nominalbetrag des Auftrages

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
NOM-URK	Urkunden Nominale/ Nennwert	10,3-stellig numerisch	muss [b]	Dieses Feld enthält den gesamten Nominalbetrag der Einlieferung/Auslieferung errechnet aus der Anzahl je Stückelung. Notwendige Angabe, wenn die Urkunden der WKN/ISIN noch nicht auf EURO umgestellt wurden. Siehe Abschnitt Hintergrund-Informationen Kapitel „EURO"
ORD-NR	Ordnungs-nummer	6-stellig numerisch	muss bei Neu-zulas-sung ohne Valutier-ung und Valutier-ung	Dient zur eindeutigen Identifikation von Sammelurkunden bei CBF.
OPPO	Oppositions-grund	3-stellig	keine	Dreistelliger Code für den jeweiligen Oppositionsgrund (siehe Kontrolle (EC) auf Seite 19-1).
POSTFACH STRASSE LAND/PLZ/ORT (Auslieferung)	Postfach Strasse Länderkennzeich en Postleitzahl Ort	Alphanumerisch	kann	Angaben zur drittbegünstigten Bank für den Empfänger der Stücke
PRIMANOTE PRIM	Primanote	4-stellig numerisch	keine	Der CBF-Kunde kann hier mehrere Aufträge unter einer von ihm selbst vergebenen Ordnungsnummer verwalten (Stapelerfassung). Für die Korrektheit dieser Nummer ist der Kunde selbst verantwortlich, da systemseitig keine Überprüfung erfolgt.
RAHMEN-NOM	Rahmen-Nominale	12-stellig numerisch	kann/ muss	Der Nominalbetrag einer Rahmenurkunde. Notwendige Angabe, bei Neuzulassung einer Rahmenurkunde. Siehe Euro-Umstellung auf Seite 26-1.
SAMMELURKUNDE	Sammelurkunde	1-stellig alphanumisch	J/N	Kennzeichen zur Unterscheidung zw. Einzel- und Sammelurkunden (bei lfd. Einlieferung)
SAMMEL-NR.	Nummer der Sammelurkunde	6-stellig numerisch	kann	Durch CBF-vergebene eindeutige Identifikation je Sammelurkunde in einer WKN/ISIN.
SB	Suchbegriff	55-stellig alphanumisch	kann	Angaben von Parametern (z. B. WKN/ISIN) zur Vereinfachung der Eingabe

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
SCHRITTWEITE	Schrittweite	11-stellig numerisch	keine/ muss	In diesem Feld muss die Anzahl der Stücke angegeben werden, die in der zu erfassenden Verbundnummer (Globalnummer) enthalten sind (von-Nr./bis-Nr.). Bei der Erfassung von Stückenummern mit gleicher Stückelung aber unterschiedlicher Schrittweite, muss dieses Feld geändert werden. Die Eingabe der Schrittweite ist nur für die Funktionen Erfassung und Änderung notwendig. Bei den Informationsanzeigen wird diese Eingabe nicht angezeigt, da sie aus der Stückenummernanzeige hervorgeht.
SERIEN-BEZEICHNUNG	Serien-bezeichnung am Wertpapier	2-stellig alphanumerisch	muss	Zusätzliche Angabe zur Stückenummer. Emissionsspezifische Darstellung der Stückenummern.
SET-DAY	Settlement-Day	8-stellig TT.MM.JHJJ	muss	Gewünschter Buchungstag Vorbelegung mit Tagesdatum
SET-STATUS/ S (Kurzanzeige)	Settlement-Status	1-stellig numerisch	keine	Informations-Kennzeichen für den Settlement-Status eines Auftrages (siehe entsprechende Tabelle im Anhang).
ST-ART	Stückeart	20-stellig alphanum.	keine	Kennzeichnet die Art des Ausdrucks der Urkunde.
STKL	Stückelung	15-stellig (2-stellig für Litera, 13-stellig für Stck.) alphanum.	muss	Aufteilung einer Emission in mehrere Nennbeträge. Innerhalb einer Einheit (Stückelung/Schrittweite) muss eine Stückenummer eindeutig sein.
STRASSE	Straße	30-stellig alphanum.	kann	Adresse des Empfängers (manuelle Eingabe)
STRASSE POSTFACH LAND/PLZ/ORT (Auslieferung)	Strasse Postfach Länderkennzeichen Postleitzahl Ort	Alphanumisch	kann	Angaben zur drittbegünstigten Bank für den Empfänger der Stücke

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
STUECKELUNGS-WUNSCH	Stückelungs-wunsch für Auslieferung	1-stellig J = JA N = NEIN	kann	Soll die Auslieferung in bestimmten Stückelungen erfolgen, kann hier der Hinweis eingegeben werden. Dazu muss dann in der Folgemaske die entsprechende (n) Anzahl Urkunden zur jeweiligen Stückelung(en) eingegeben werden. Vorbelegung: "N"
STUECKENUMMERN	siehe Abschnitt Stückenummern in diesem Kapitel sowie einzelne Auftragsarten			Stückenummern auf den Urkunden
SUMME-NOM	Summe-Nominale	10,3-stellig numerisch	keine	Der Nennwert der einzelnen erfassten Stücke wird addiert. Die Summe-Nom muss mit der einzuliefernden Nominale bei der Kontrolle durch den Kunden und/oder Freigabe des Auftrages durch die CBF übereinstimmen. Ist dies nicht der Fall, wird die Summe-Nom farblich abgehoben angezeigt.
TEXT	Text	70-stellig alphanum.	kann	Hier können zusätzlich Informationen durch den Kunden eingetragen werden.
TRAN	Transaktions-Code	4-stellig alphanum.	muss	Auswahl der gewünschten Transaktion (z. B. KVEW - Effekten-Auslieferung)
UEBERFAELLIGER KUPON VON ... BIS	überfälliger Kupon von ... bis ...	10- oder 3-stellig numerisch	kann	Hier werden die noch nicht eingelösten Kupons (Nummer oder Datum) eingegeben (nur CBF).
UEBERFAELIGER LEG.SCHEIN VON ... BIS ...	überfälliger Legitimationsschein von ... bis ...	10- oder 3-stellig numerisch	kann	Hier werden die noch nicht eingelösten Kupons (Nummer oder Datum) eingegeben (nur CBF).

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
UMLEGUNG	Umlegung	1-stellig numerisch, Textanzeige 10-stellig alphanum.	kann	Durch Umlegung können Urkunden von einem Tresorart in eine andere umgelegt werden. Folgende Umlegungsvorgänge sind möglich: 1 = Vorratslager in GS 2 = GS in Vorratslager 3 = GS in FTB 4 = FTB in GS 5 = FTB in FTB 6 = Umlegung RU Die Umlegungsarten 3-5 sind nur für Outsourcer möglich, Umlegungsart 6 nur für TEFRA D-Anleihen.
UMSATZART	Umsatzart	1-stellig alphanum.	[a]	Mögliche Ausprägungen bei der Depotumsatzabfrage: L = Lastschrift G = Gutschrift
USER-ID	User-Identifier	10-stellig numerisch	keine	Beinhaltet die User-ID des Anwenders.
USER-ID ERFASSER	User-Identifier des Erfassers	10-stellig numerisch	keine	User-Identifizierung wird bei allen Bearbeitungsschritten zusammen mit Datum und Uhrzeit beim Auftrag gespeichert
USER-ID KONTROLLEUR	User-Identifier des Kontrolleurs	10-stellig numerisch	keine	User-Identifizierung wird bei allen Bearbeitungsschritten zusammen mit Datum und Uhrzeit beim Auftrag gespeichert
VALUTA LTE.BEW.	Valuta letzte Bewegung	TT.MM.JJJJ	keine	In diesem Feld wird in der Depotbestandsanzeige die letzte Bewegung auf diesem Konto angezeigt.
VERWAHR-MOEGLICHKEIT	Verwahr-Möglichkeit	3-stellig numerisch		Beschreibt die Hinterlegung der jeweiligen WKN/ISIN bei der CBF gemäß WM. Die korrespondiert mit der Tabelle Stückeart.
WKN	Wertpapier-Kennnummer	siehe Erklärung	muss	Abhängig von der Eingabe bei der WP-Kennung gelten für die WKN/ISIN folgende Bedingungen (siehe auch WP-Kennung). W = 6-stellig numerisch I = 12-stellig alphanumerisch B = 3 bzw.4-stellig alphanum.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
WKN DES RECHTS	Wertpapier-Kennnummer des Rechts	siehe WKN	muss bei RS	Eingabe bei Neuzulassung, Valutierung in Namensaktien zur eindeutigen Zuordnung der Kapitalmaßnahmen.
WKN-KENNUNG-D-RECHTS	Wertpapierkennung des Rechts	1-stellig alphanum.	muss	Siehe WP-Kennung
WKN-Info	Wertpapier-Kennnummer	Textfeld	keine	Erste Zeile: → Zinssatz → Kurzbezeichnung → Zinstermin der Gattung Zweite Zeile: → Gattungssperre mit Gültigkeitszeitraum → Verlosungs-, Rückzahlungs- bzw. Kündigungsinformationen → bei Einlieferung von RS: GS-Stichtag für RS
WKN-Stammrecht	Wertpapier-Kennnummer des Stammrechts bei Einlieferung von Bezugsrechten	siehe WKN	muss	In diesem Feld wird die Wertpapierkennnummer eingegeben, welche dem eingelieferten Bezugsrecht als Stamm-WKN/ISIN zugeordnet ist.
WKN-KENNUNG-D-Stammrechts	Wertpapier-kennung des Stammrechts	1-stellig alphanum.	muss	Siehe WP-Kennung
WOHNORT	Wohnort	35-stellig alphanum.	keine	Hier wird der Wohnort des Aktionärs gemäß Aktienbuch des Emittenten angezeigt.
WP-KENNUNG	Wertpapier-Kennung	1-stellig alphanum.	muss	Eingabemöglichkeiten: W = Deutsche WKN I = ISIN B = Börsenkürzel Vorbelegung: "I"

a. Muss- oder Kannfeld hängt vom jeweiligen Vorgang ab.
b. Eines der beiden Felder muss gefüllt sein.

10 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

10.1 Stückenummern

Die Stückenummern auf den Urkunden, die beim bzw. über die CBF effektiv bewegt werden sollen, sind Bestandteil der jeweiligen zugrundeliegenden Aufträge. Die Erfassung der Stückenummern richtet sich in Format und Inhalt weitestgehend nach der ISO-Norm. Bei der Eingabe jeder einzelnen Stückenummer findet ein Abgleich gegen alle bereits in den CBF-Anwendungen (CARAD oder Aufträge im Auftragsstatus) vorhandenen Stückenummern statt. Dadurch wird eine doppelte Nummernerfassung bzw. Hinterlegung bei CBF unmöglich.

Darüber hinaus prüft CASCADE mit der Verarbeitung der Stückenummern sofort gegen vorhandene Oppositionsangaben aus den aktuellen Daten der WM für die Wertpapiere.

Bei Einlieferungen von effektiven (vinkulierten) Namensaktien werden die Stückenummern zusätzlich gegen die Stückenummern des Aktionärs (Zession) aus dem Aktienbuch des Emittenten geprüft. Sind die Stückenummern nicht der eingegebenen Aktionärsnummer zuordenbar, wird die Eingabe abgelehnt.

10.1.1 Erfassung der Stückenummern – Begriffe und Zeichensatz

Einzelne Stückenummern (Einzelurkunde)

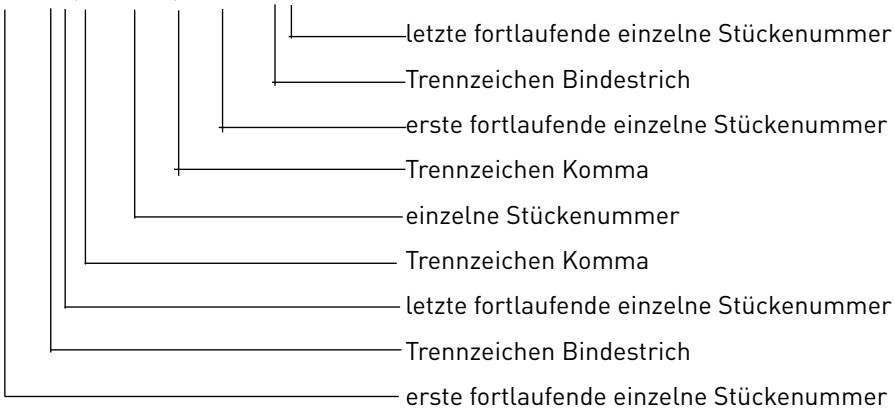
Eine einzelne (Stücke-) Nummer mit den Ziffern 0 bis 9 gemäß den Angaben auf der Urkunde identifiziert ausdrücklich einen einzelnen Titel. Einzelne Stückenummern bzw. einzelne, lückenlos aufeinanderfolgende Stückenummern werden durch Komma oder Blank getrennt.

Beispiel:

Eingabe *einzelner* und *einzelner fortlaufender* Stückenummern je Stückelung in CASCADE:

WKN/ISIN DE0007614401
Stückelung 100
Stückenummern auf den einzuliefernden Urkunden:
565001
565002
565003
565005
565007
565008

565001 - 3 , 565005 , 565007 - 8



Hinweis:

Die Schrittweite zur Eingabe einzelner Stückenummern beträgt immer 1, da die Urkunde eine Nummer beinhaltet. Bei der Eingabe von Stückenummern mit Schrittweite größer 1 (Verbundnummern) kann der Fließtext über 2 Zeilen gehen; dann muss das Zeichen "-" am Ende der Zeile erfasst werden.

Verbund(global)nummern

Verbundnummern charakterisieren lückenlos vergebene Wertpapiernummern, die einen Titel identifizieren, der keine eigene Nummer aufweist. Die kleinste Nummer (Von-Nr.) und die größte Nummer (Bis-Nr.) werden durch Schrägstrich verbunden.

Beispiel:

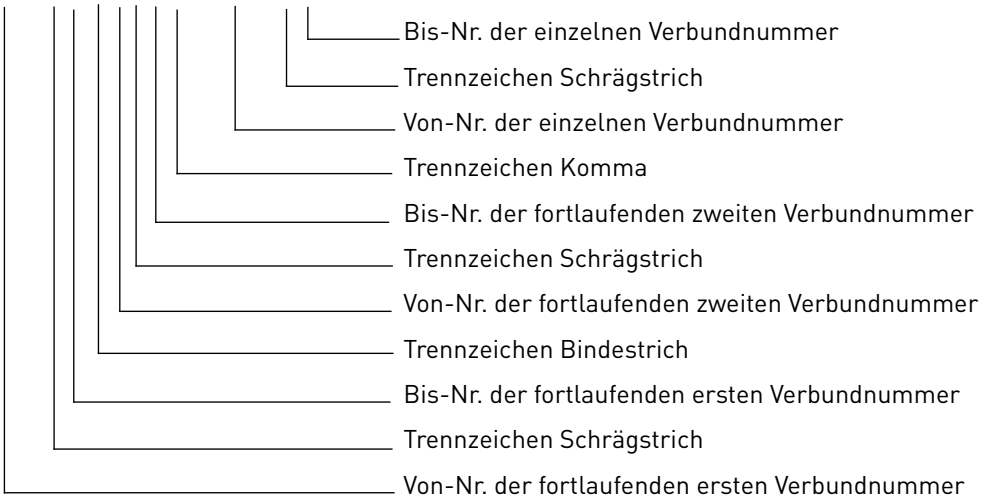
Eingabe von *Verbundnummern* je Stückelung in CASCADE:

WKN/ISIN DE0007614401
Stückelung 200
Schrittweite 20

Verbundnummern auf den einzuliefernden Urkunden:

13760805/24
13760825/44
13902405/24

13760805/24 - 25/44 , 13902405/24



Hinweis:

Die Anzahl der Verbundnummern auf der Urkunde wird im Feld Schrittweite angegeben. Im oben aufgeführten Beispiel beträgt die Schrittweite 20, da die drei Urkunden jeweils 20 Stücke umfassen.

10.1.2 Erfassung von Ziffern, Buchstaben und Zeichen für Stückenummerneingabe

Es stehen folgende Ziffern, Buchstaben und Zeichen für die Stückenummerneingabe zur Verfügung:

Bestandteil Stückenummerneingabe auf der Bildschirmmaske	Bedeutung korrekt	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
0-9	Stückenummer	12-stellig (max.) 17-stellig mit Litera numerisch	muss	Zahlen gemäß den Ziffern auf der Urkunde
1-10 A-K römische Ziffern zweistellig	Litera/ STCKL	2-stellig alphanumisch	a	Litera der Stückelung (Angabe nur; wenn innerhalb einer Stückelung verschiedene Litera für die Stückenummern existieren).
,	Komma	1-stellig alphanumisch	a	Komma und/oder Blank werden als Trennzeichen hinter jeder Nummer und/oder Nummernfolge verwendet.
-	Bindestrich	1-stellig alphanumisch	a	Bindestrich verbindet die erste mit der letzten Stückenummer bei Nummernkreisen; mindestens zwei physische Wertpapiere
/	Schrägstrich	1-stellig alphanumisch	a	Schrägstrich verbindet Von- und Bis- (Globalnummern); ein einziges physisches Wertpapier bzw. innerhalb einer Sammelurkunde verbriefter Nummern.

a. Muss- oder Kanneingabe kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

10.1.3 Anzeige der Stückenummern in der Anwendung

Die CASCADE-Anwendung setzt die unten aufgeführten Zeichen automatisch bei der Anzeige der Stückenummern.

Bestandteil Stückenummerneingabe auf der Bildschirmmaske	Bedeutung korrekt	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
*	Stern	1-stellig alphanumisch	keine	Dient in der Kombination '*' zur Kennzeichnung von genau 100 Stückenummern in der Zeile.
<	Kleiner Zeichen	1-stellig alphanumisch	keine	Dient zur Kennzeichnung von 99 oder weniger Stückenummern in einer Zeile.

10.1.4 Bearbeitung der erfassten Stückenummern

Erfasste oder weitererfasste Stückenummern bzw. Nummernfolgen können in der CASCADE-Erfassung und/oder Änderung/Löschung auch in den Eingabezeilen bearbeitet werden. Die Anzeige der letzten erfassten Stückenummer erfolgt in einer separaten Zeile. Für die Bearbeitung der Stückenummern sowohl in der CASCADE-Erfassung als auch im Änderungsdienst stehen verschiedene Kennzeichen zur Verfügung, die gemischt oder aufeinander aufbauend verwendet werden. Eine in der 1. Zeile erfasste und abgespeicherte Stückenummer könnte somit in der zweiten Zeile zur Löschung markiert werden.

Kennzeichnung zur Bearbeitung von Stücke-nummern	**Bedeutung**	**Formal korrekt**	**Ein-gabe**	**Erklärung**
A und N	Änderung bereits **gespeicherter** Stückenummern	1-stellig alphanumisch	A	Die Kennzeichen A und N sind nur kombiniert nutzbar. Mit A wird in der 1. Zeile die Stückenummer eingegeben, die geändert werden soll. Mit N wird in der nächsten Zeile die neue Stückenummer **eingegeben.** Damit wird eine bereits gespeicherte Stückenummer geändert und die neue Stückenummer behält die Position der alten Stückenummer im Auftrag bei. Die Anzahl der neuen Stückenummern kann gleich oder kleiner sein als die Anzahl der alten Stückenummern. Bei der Änderung von Stückenummern für Sammelurkunden muss die Stückelung in einer Zeile beibehalten werden. Nur bei Einzelurkunden: Die Eingabe von Mängelkennzeichen bzw. die Kennzeichnung als Ersatzstücke für die 'alten' Stückenummern werden nicht übernommen. Diese Informationen können mit den neuen Stückenummern erfasst werden.
E	Änderung von Stückenummern/ Nummernfolgen	1-stellig alphanumisch	E	Mit der Eingabe der Kennzeichnung "E" Ersatzurkunde werden andere Kennzeichnungen komplett überschrieben. Die Verarbeitungstasten PF3 und PF6 speichern die Neueingabe.
M	Änderung der Mängelgründe von Stückenummern/ Nummernfolgen	1-stellig alphanumisch	M	Änderung eines bereits eingegebenen Mangels für genau eine Stückenummer/ Nummernfolge. Mit der Eingabe von neuen Mängel werden alle bereits eingegebenen Mängel (ausgenommen Oppositionsmängel) komplett überschrieben. Die Verarbeitungstasten PF3 und PF6 speichern die Neueingabe. Die Datenfreigabe ignoriert die Neueingabe und blendet die 'alten' Mängel ein.

Kennzeichnung zur Bearbeitung von Stücke-nummern	Bedeutung	Formal korrekt	Ein-gabe	Erklärung
L	Löschung einer Stückenummer/ Nummernfolge	1-stellig alphanumisch	L	Löschung von Stückenummern/ Nummernfolgen im Auftrag, wobei nicht alle zu löschenden Stückenummern im Auftrag vorhanden sein müssen. Die Löschung wird jedoch abgewiesen, wenn keine einzige Stückenummer im Auftrag gespeichert ist. Die Eingabe von Mängel für die Stückenummern bzw. die Kennzeichnung als Ersatzstücke ist nicht möglich.

Hinweis:

Bei der Bearbeitung von bereits erfassten Stückenummern und/oder Mängelgründen mit den Kennzeichen "A", "M" oder "N" müssen die Stückenummern so eingegeben werden, wie sie im Auftrag bei der Erfassung gespeichert wurden.Bei der Bearbeitung der Stückenummern/Nummernfolgen anhand der beschriebenen Kennzeichen ist zu beachten, dass die Tasten PF3 und PF6 die Daten zur Verarbeitung freigeben. Die Bearbeitung mit der ENTER-Taste führt nicht zur Verarbeitung der Daten. Eine aufeinander aufbauende Bearbeitung der Stückenummern nach der "ENTER-Eingabe" führt deshalb in der zweiten Zeile zur Fehlermeldung.

10.2 Die Kundenreferenz

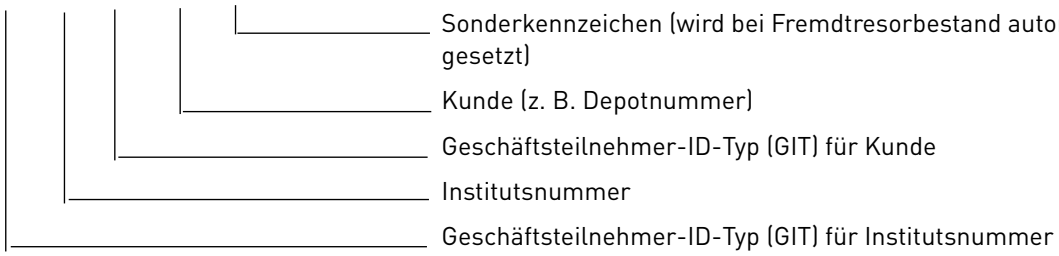
Die Kundenreferenz ermöglicht dem Eingeber je gewählter Auftragsart, Auftragsinformationen zum Auftraggeber bzw. Endbegünstigten zu spezifizieren. Sofern kein zweiter Kunde der CBF am Auftrag beteiligt ist, enthält die Kundenreferenz stets die Geschäftsteilnehmerdaten der eingebenden Seite. Bei (vinkulierten) Namensaktien (Registered Shares - RS) und Fremdtresorführung (FTB) dient die Kundenreferenz auch als Merkmal für die erweiterte Bestandsführung in diesen Gattungen.

Format und Inhalt der Kundenreferenz sind entsprechend standardisiert und werden, sofern allgemein gültig, in den nachfolgenden Abschnitten beschrieben. Auftragsspezifische Gegebenheiten sind in den entsprechenden Kapiteln dokumentiert.

10.2.1 Format der Kundenreferenz

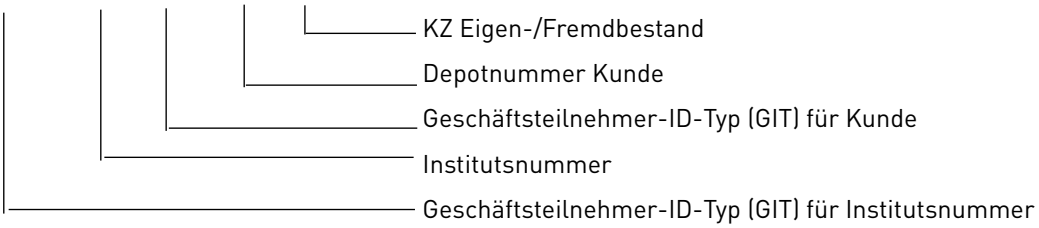
Format und Inhalt des Feldes Kundenreferenz gliedern sich wie folgt:

...-..... ...-..... ..



Beispiel:

BIC - DE00123 KTO – 123456 E



Bestandteil Kundenreferenz	Bedeutung korrekt	Formal	Eingabe	Erklärung
Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT)	Geschäfts-teilnehmer-Identifikations-Typ (GIT)	3-stellig alphanum.	a	Dieses Feld kann mit einem dreistelligen Kürzel belegt werden, welches die Angabe der Kundenreferenz Drittbank bzw. des Kunden im Hinblick auf eine maschinelle Weiterverarbeitung unterstützt. Folgende Inhalte werden derzeit als Eingabe empfohlen (abhängig von der Auftragsart: - BIC für Bank-Identifikations-Code - BLZ für Bankleitzahl - KTO für Konto Wird die Kundenreferenz GIT Drittbank mit einem der aufgelisteten Kürzel belegt, muss eine Eingabe für die Kundenreferenz Drittbank erfolgen.
Drittbank	Drittbank	max. 11-stellig alphanum.	a	Konto-/-Filial-/ Institutsnummer einer Bank, für die ein Kunde der CBF den CASCADE-Auftrag eingibt. Die formale Eingabe der Drittbank richtet sich nach der gewählten GIT Drittbank: GIT Drittbank BIC durchgängig: 8- oder 11-stellig BLZ 8-stellig KTO →0 Die Kundenreferenz Drittbank kann auch ohne Angabe einer Drittbank angegeben werden.

Bestandteil Kundenreferenz	Bedeutung korrekt	Formal	Eingabe	Erklärung
Kunde	Kunde	max. 13-stellig alphanum.	a	Konto-/Filialnummer der Niederlassung eines Kunden bzw. Kontonummer des Kunden, der hinter dem Kunden der CBF bzw. der Drittbank steht (Auftraggeber, Begünstigter). Die formale Eingabe des Kunden richtet sich nach der gewählten GIT Kunde: GIT Drittbank BIC durchgängig: 8- oder 11-stellig BLZ 8-stellig KTO >0 Die Kundenreferenz Kunde kann auch ohne Angabe einer GIT für den Kunden eingegeben werden.
Sonderkennzeichen	Sonderkenn-zeichen	2-stellig numerisch		Kennzeichen Eigen-/ Fremdbestand wird bei Fremdtresor-Verwahrung automatisch in Abhängigkeit zur Kontierung automatisch gesetzt: E – Eigenbestand F – Fremdbestand KZ ist Bestandteil des SIM (Streifband identifizierendes Merkmal)

a. Muss- oder Kannfeld hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

Leerseite

11 Hauptauswahlmenü CASCADE-Auftragsabwicklung

Durch Eingabe des Funktionscodes "CA" im Einstiegsmenü "Funktionsangebot für den Bereich CBF – Inland" wird das Hauptauswahlmenü "CASCADE" Auftragsabwicklung aufgerufen:

```
TRAN: MENU FC:     SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

       ERFASSUNGSSTATUS                       AUFTRAGSSTATUS

       EE   ERFASSUNG GIROBEREICH BANK        AM   MATCH-DIENST
       EW   ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK       AS   SETTLEMENT-DIENST
       ED   ERFASSUNG CBF                     AI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EA   AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.      AA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       EB   AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.     AR   RESERVIERUNGS-DIENST
       EI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EK   KONTROLLE GIROBEREICH
       EC   KONTROLLE WERTEBEREICH            DISPOSITIONSSTATUS

       BOERSENGESCHAEFTSABWICKLUNG            DI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK

       LS   SETTLEMENT BEARBEITUNG            NACHRICHTENABWICKLUNG
       LA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       LI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK          NI   INFORMATION

-- ID-KZ: 7999230003 -- PW:          ------ B7907495 -- 19/05/04 -- 14:00:14 --

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

Leerseite

12 Erfassung von Aufträgen (EW)

Unter der Erfassung ist die Ersteingabe von Aufträgen in den Erfassungsstatus zu verstehen.

Kunden können zur Erfassung von Aufträgen für den Effektivbereich derzeit folgende Funktionscodes nutzen:

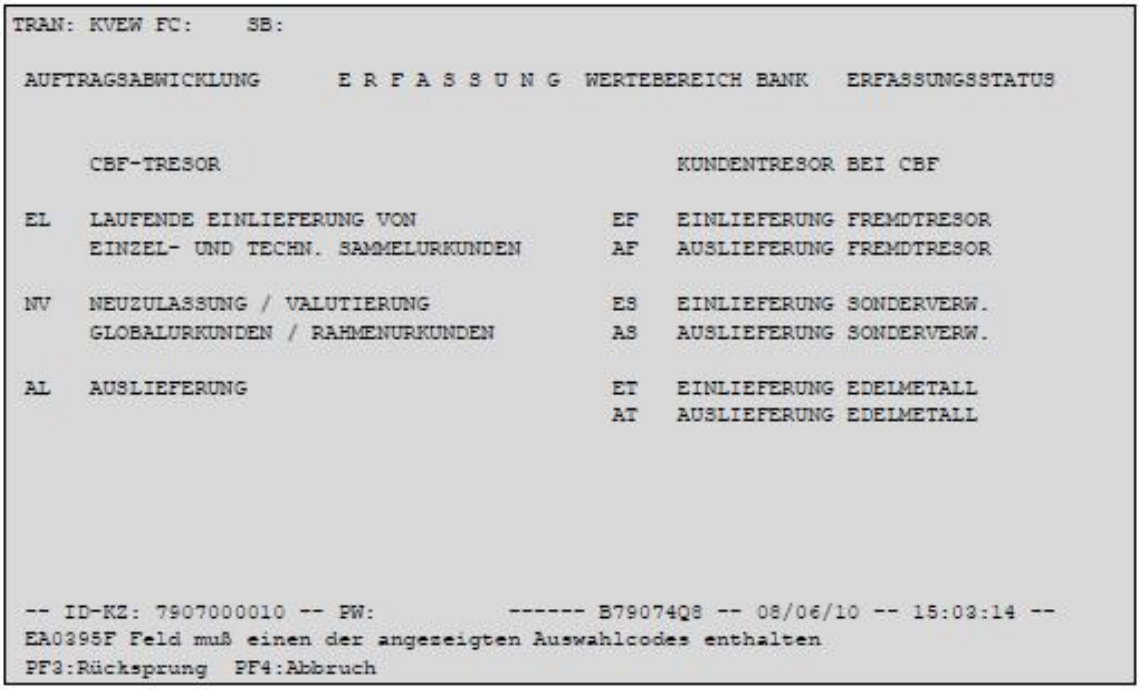
EL	Laufende Einlieferung von Einzel- und techn. Sammelurkunden
NV	Neuzulassung/Valutierung von Globalurkunden/Rahmenurkunden
AL	Auslieferung von Einzel- und techn. Globalurkunden/Revalutierungen/Umlegungen/ Globalurkunden und Jungscheinen
ES	Einlieferung Sonderverwahrung (nur für Sonderverwahr-Kunden)
AS	Auslieferung Sonderverwahrung (nur für Sonderverwahr-Kunden)
EF	Einlieferung Kundentresor (nur für Outsourcer-Kunden)
AF	Auslieferung Kundentresor (nur für Outsourcer-Kunden)
ET	Einlieferung Edelmetall (nur für Kunden die Edelmetall bei CBF hinterlegen)
AT	Auslieferung Edelmetall (nur für Kunden die Edelmetall bei CBF hinterlegen)

Um die Erfassung bei einer Einlieferung zu vereinfachen, wurden mit Release 8 im Juni 2003 die Funktionalitäten für Neuzulassung/Aufstockung Globalurkunden (früher EN) und Valutierung Rahmenurkunde (früher EV) in einer neuen Funktion NV zusammengelegt. Damit kann jede dauerverbriefte Urkunde bzw. Rahmenurkunde eingeliefert werden. Außerdem ist es möglich, die Neuzulassung einer Rahmenurkunde mit einer gleichzeitigen Valutierung dieser Urkunde zu verknüpfen.

Die Funktionen "EF, AF, ES, AS, ET und AT" stehen nur solchen Kunden zur Verfügung, die im Rahmen eines Outsourcings ihre Tresore an CBF übergeben haben. Die entsprechenden Funktionalitäten sind in einem separierten Benutzerhandbuch beschrieben, das aber nur für die entsprechenden Outsourcer-Kunden zur Verfügung gestellt wird.

Nähere Auskünfte zu den Möglichkeiten der Sonderverwahrung im CBF-Tresor erteilt der Clearstream Banking CSD Client Services Core Products and Connectivity.

Ausgehend von dem Hauptauswahlmenü der CASCADE-Auftragsabwicklung gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes “EW” zum Auswahlmenü der Erfassung für den Wertebereich Bank:


TRAN: KVEW FC: SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG E R F A S S U N G WERTEBEREICH BANK ERFASSUNGSSTATUS
CBF-TRESOR
KUNDENTRESOR BEI CBF
EL LAUFENDE EINLIEFERUNG VON
EINZEL- UND TECHN. SAMMELURKUNDEN
EF EINLIEFERUNG FREMDTRESOR
AF AUSLIEFERUNG FREMDTRESOR
NV NEUZULASSUNG / VALUTIERUNG
GLOBALURKUNDEN / RAHMENURKUNDEN
ES EINLIEFERUNG SONDERVERW.
AS AUSLIEFERUNG SONDERVERW.
AL AUSLIEFERUNG
ET EINLIEFERUNG EDELMETALL
AT AUSLIEFERUNG EDELMETALL
-- ID-KZ: 7907000010 -- PW: ------ B79074Q8 -- 08/06/10 -- 15:03:14 --
EA0395F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

12.1 Erfassung von Aufträgen zur laufenden Einlieferung von Wertpapieren (EL)

Folgende Aufträge werden hier erfasst:

- laufende Einlieferungen von Einzelurkunden mit Einzel- und Verbundnummern
- laufende Einlieferungen von technischen Sammelurkunden
- laufende Einlieferung als Urkundenumtausch von Einzelurkunden
- laufende Einlieferungen als Urkundenumtausch von technischen Sammelurkunden

Die Einlieferungen der Urkunden bei der CBF erfolgen in den Verfahren

- Einzel- bzw. Sammeleinlieferung per Bankboten
- Sammeleinlieferung im Container
- Einlieferung per Wertpost

Die Daten für einen zu erfassenden Einlieferungsauftrag in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- weitere wertpapierrelevante Folgedaten (Folgemaske 1)
- Stückenummern (Folgemaske 2)
  - für Einzelurkunden oder
  - für technische Sammelurkunden

Die Erfassung des Einlieferungsauftrages ist unabhängig vom gewählten Einlieferungsverfahren.

Nach Eingabe des Funktionscodes "EL" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt.

12.1.1 Buchungsrelevante Auftragsdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Einlieferungsauftrag bei der CBF buchen zu können.

(B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten

```
TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG       ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE:  653           AUFTNR:   6530000        HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0007224008 SEDLMAYR S.-FR.KGAAO.N.

NOMINALE :          1.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          1.000          EINLIEF-ART  : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                                   EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ       : ___ - __________ ___ - ___________      KZ-BST: __
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT: I __________

BEARB-STATUS:  10 EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU WENIG STUECKE


-- ID-KZ: 7930200001 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 10:41:13 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d.h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:	Beschreibung
AUFTNR		
HLG	"01" (GS)	Girosammelverwahrung
EINLIEF-ART	"1"	laufende Einlieferung
LAST-KTO	interne Kontonummer der CBF	Tresorkontonummer
GUT-KTO	Bank-Nr. des erfassenden Institutes	
WKN-KENNUNG	"I"	ISIN
WKN		
NOMINALE		Buchungsnominale
NOM-URK		Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung bei nicht in EURO umgestellten WKN/ISIN. Weicht ab von Nominale.
KUNDENREFERENZ GIT-DRITTBANK		
KZ-BEST	"HB"	"Hauptbestand", nur bei Namensaktie (RS)

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für eine laufende Einlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Kunden (Eingeber) darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den CBF internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
GUT-KONTO	Niederlassungen können nur Einlieferungen zugunsten der Zentrale tätigen.(Reg-Über-Bedingungen)
EINLIEF-GRUND	Das Feld kann bei Neuzulassung und Valutierung wie folgt belegt werden: "1" aus Emission: Wird belegt, wenn die effektiven Urkunden neu emittiert eingeliefert werden. "5" Urkundenumtausch: Hier findet eine Prüfung auf doppelte Stückenummern zunächst nur im CASCADE-Erfassungs- und Auftragsstatus statt. Die endgültige Prüfung obliegt der CBF.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST-KTO/GUT-KTO

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

Entspricht das Gut-Konto einem Kundenkonto Spezialabwicklung, dann muss es sich beim Last-Konto ebenfalls um ein Tresorkonto Spezialabwicklung handeln.

GUT-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen. Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen (ausgenommen, wenn es sich bei dem Gut-Konto um die Konto-Art zum 'Einrichten von Teilbeständen nur Kundenbestand' handelt).

GUT-KTO/HLG

Entspricht das Gut-Konto einem internationalen Partner der CBF, ist nur die Hinterlegungsart

01 = Girosammelverwahrung

erlaubt.

GUT-KTO/LAST-KONTO/HLG

Handelt es sich beim Gut-Konto um ein Kundenkonto aus dem Bereich Treuhand/Vorratslager/Rückgabe für Fonds, so muss das Last-Konto diesem entsprechen und als Hinterlegungsart ist nur (GS-) Vorratslager Bank (03) möglich.

Ist die HLG 20, dann muss das Lastkonto die Kontoart 261 haben.

GUT-KTO/EINLIEFERUNG-VON NAME

Entspricht das Gut-Konto einem internationalen Partner der CBF = OEKB, EUROCLEAR FRANCE, NECIGEF, CBL oder SIS, wird der Einlieferung-von-Name automatisch eingeblendet bzw. überschreibt den vorhandenen Text.

NOMINALE/NOM-URK

Einlieferung: bei Angaben im Feld Nominale (= Buchungsnominale) wird die mögliche Nominale (NOM-URK) nach Stückelung und Urkundennominale systemsseitig ermittelt. Wird das Feld Nominale-Urkunde gefüllt, wird systemseitig das Feld Nominale ermittelt und gefüllt. Werden beide Felder gefüllt, werden systemseitig die Inhalte geprüft.

WKN/HLG

- In der HLG 01 sind nur GS-Gattungen erlaubt, die nicht VWM 96 oder 97 sind.
- In der HLG 03 sind nur GS-Gattungen erlaubt, die nicht VWM 96 oder 97 sind.
- In der HLG 20 gibt es keine Einschränkungen
- In der HLG 21 sind nur Gattungen in der Verwahrart STR erlaubt
- HLG 30 ist nicht für CBF-Tresor erlaubt (siehe Benutzerhandbuch Fremdtresor)

WKN/KZ-BESTAND/KUNDENREFERENZ

Bei Einlieferung von Namensaktien (RS) ist dieses Feld mit dem entsprechenden Bestandskennzeichen "FM"– Freier Meldebestand oder "HB" – Hauptbestand zu pflegen. Bei HB ist das Feld Kundenreferenz ebenfalls zu bearbeiten.

WKN/WKN-STAMMRECHT

Handelt es sich bei der WKN/ISIN um ein Bezugsrecht, dann muss zusätzlich die WKN/ISIN des Stammrechtes eingegeben werden.

EINLIEF-GRUND/GUT-KONTO

Handelt es sich beim Gut-Konto um ein "frei verfügbares Konto", dann muss der Einlieferungsgrund 5 (Urkundenumtausch) sein.

12.1.2 Wertpapierrelevante Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Für die korrekte Bearbeitung und Abwicklung eines Einlieferungsauftrages müssen neben den buchungsrelevanten Informationen noch weitere wertpapierspezifische Daten im Auftrag erfasst werden. Dazu wird nach der Verarbeitung der buchungsrelevanten Auftragsdaten auf eine Folgemaske verzweigt.

(B) Folgemaske wertpapierrelevanter Daten

```
TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / FOLGEERFASSUNG        ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR:   6530000                                  WKN:  I DE0007224008
                                                   HLG: 01 GS

VERWAHR-MOEGLICHKEIT    :   9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG :   0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :         16               LETZT. KUPON  :         20
ANHAENGENDER TALON      :
UEBERF KUPON        VON :                          BIS           :

NACHWEISART:   1 EINLIEF. EFF. URK.                SAMMELURKUNDE : N (J/N)



TEXT:

-- ID-KZ: 7930200001 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 10:42:04 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Vor  PF7:Zurück
```

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten gelten folgende Besonderheiten:

Feld	vorbelegt mit:
PRIMANOTE	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
AUFTRNR	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen
WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
HLG	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
LETZTER KUPON	Vorbelegung durch Wertpapierstammdaten. Bei Optionsscheinen wird dieses Feld als letzter LEG-SCHEIN angesetzt
NACHWEISART	“1” (Einlieferung effektiver Urkunden) “4” (Einlieferung ohne Urkunden-Rahmenvertrag RS) “5” (Einlieferung mit Urkunden RS)
SAMMELURKUNDE	“N”
ABWEICHENDE BEZEICHNUNG	0 (kein Eintrag)

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten für eine lfd. Einlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
NÄCHSTER KUPON/NÄCHSTER	Die Eingabe für dieses Feld wird gegen die zum Wertpapier gespeicherten
LEG-SCH	Informationen geprüft und entsprechend belegt. Bei Renten erfolgt eine Datumsprüfung, bei Aktien eine numerische und bei Optionsscheinen erfolgt eine alphanumerische Prüfung (LEGSCHEIN).
SAMMELURKUNDE	Es sind folgende Eingabekombinationen in Verbindung mit den folgenden Verwahrmöglichkeiten zugelassen: – Girosammelverwahrung (GS) effektiv – GS-Verwahrung, Stückelos (nur in Form von CF-Stücken lieferbar) – Eingeschränkte Girosammelverwahrung Kombinationen: Laufende Einlieferung effektiver GS-Gattungen mit Einzelurkunden: Mit Kennzeichen Sammelurkunde "N" für "Nein" und Einlief-Grund = keine Eingabe. Laufende Einlieferung als Urkundenumtausch von Einzelurkunden Mit Kennzeichen Sammelurkunde auf "N" für "Nein" und Einlief-Grund = 5 für Urkundenumtausch. Laufende Einlieferung als technische Sammelurkunde Mit Kennzeichen Sammelurkunde auf "J" für "Ja" und Einlief-Grund = keine Eingabe. Laufende Einlieferung als Urkundenumtausch von Sammelurkunden Mit Kennzeichen Sammelurkunde auf "J" für "Ja" und Einlief-Grund = 5 für Urkundenumtausch.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

WKN/BESONDERHEIT

Für Einzelurkunden sind nachfolgende Besonderheiten erlaubt:

- 2 (bogenlos)
- 3 (nur Mantel, kein Bogenausdruck)
- 4 (Einzelurkunde Mantel/Globalbogen)
- 5 (Mantel, Bogen, Zession (für RS))
- 6 (Mantel, Talon, Zession (für RS))
- 9 (Einzelurkunde, Globalmantel/Einzelbogen)
- 11 (Alte Urkunden)
- 20 (Technische Globalurkunde mit Bogen; manuell erstellt)
- 21 (Technische Globalurkunde ohne Bogen; manuell erstellt)
- 22 (Technische Globalurkunde mit Bogen; lieferbar)
- 23 (Technische Globalurkunde ohne Bogen; lieferbar)
- 27 (Festschreibung)

Für Sammelurkunden sind nachfolgende Besonderheiten zulässig:

- 15 (Nur Mantel)
- 16 (Unikat)
- 17 (Unit)

- 20 (Technische Globalurkunde mit Bogen, manuell erstellt)
- 21 (Technische Globalurkunde ohne Bogen, manuell erstellt)
- 22 (Technische Globalurkunde mit Bogen, lieferbar)
- 23 (Technische Globalurkunde ohne Bogen, lieferbar)
- 24 (Mit Bogen)
- 25 (Ohne Bogen)
- 26 (JSG ohne Bogen)
- 28 (Nur Bogen)
- 40 (Kein Zinsschein/Talon)
- 41 (Nur Talon)
- 47 (IGL mit Bogen)
- 48 (IGL ohne Bogen)
- 49 (Jungschein mit Bogen)
- 52 (Dauerglobalurkunde mit Bogen)
- 53 (Dauerglobalurkunde ohne Bogen)
- 54 (Rahmenurkunde mit Bogen)
- 55 (Rahmenurkunde ohne Bogen)
- 56 (Globalbonds mit Bogen)
- 57 (Globalbonds ohne Bogen)

Bei der Auftragserteilung von Neuzulassungen über die CASCADE Transaktion KVEW NV wird das Feld "Besonderheit" unter den unten aufgeführten Bedingungen vorbelegt.

- Bei Valutierungen (Einlieferungsart 5) ist das Feld nicht eingebbar und wird auch nicht vorbelegt.
- Globalbonds (KV-Lagerland = 998) werden mit der Besonderheit 57 "Globalbonds ohne Bogen" vorbelegt.
- RS-Gattungen werden je Verwahrmöglichkeit wie folgt mit der Besonderheit vorbelegt:
  - VWM 14: Vorbelegung mit Besonderheit 55 "Rahmenurkunde ohne Bogen"
  - VWM 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 "IGL ohne Bogen"
  - VWM 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 "technische Globalurkunde ohne Bogen lieferbar"
- TEFRA D Anleihen werden mit der Besonderheit 55 "Rahmenurkunde ohne Bogen" vorbelegt.
- Für Lieferungen in der Einlieferungsart 2 gelten folgende Regeln:
  - VWM 1, 2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 "Jungschein ohne Bogen"
  - VWM 5: Vorbelegung mit Besonderheit 48 "IGL ohne Bogen"
  - VWM 9, 16: Es erfolgt keine systemseitige Vorbelegung. Das Feld Besonderheiten wird durch die CBF Prüfstelle ergänzt.
- Sonstige VWM: Vorbelegung mit Besonderheit 53 "Dauerglobalurkunde ohne Bogen"
- Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 unterliegen folgenden Regeln:
  - VWM 9, 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 "technische Globalurkunde ohne Bogen"
  - VWM 1,2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 "Jungschein ohne Bogen"
  - VWM 5, 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 "IGL ohne Bogen"

Ausnahmen sind WKN/ISIN mit den Stückearten “Nur Mantel” und “Unikat”. Bei WKN/ISIN mit der Stückart “Nur Mantel” können die Besonderheiten 21 und 23, bei WKN/ISIN mit der Stückeart “Unikat” können die Besonderheiten 20 und 22 eingegeben werden. Für RS-Gattungen sind nur die Besonderheiten 5 und 6 erlaubt.

Für CBF Kunden, die zur Auftragserteilung den EDT-Services (Premium) nutzen und somit keine Möglichkeit der Spezifizierung von Besonderheiten haben, wird gemäß den o.a. Bedingungen vorbelegt.

GUT-KTO/ÜBERFÄLLIGER KUPON BIS

Die Eingabe für in dem Feld überfälligen Kupon ist nur durch die CBF möglich.

NACHWEISART/WKN

Wenn es sich bei der einzuliefernden WKN um eine RS-Gattung handelt, dann ist nur die Nachweisart 4 und 5 erlaubt, ansonsten die Nachweisarten 1, 2, 3.

12.1.3 Folgedaten Stückenummern

(A) Allgemeine Beschreibung

Zur vollständigen Auftragserteilung ist es notwendig, die zugehörigen Stückenummern der einzuliefernden Urkunden im Auftrag anzugeben. Zur Erfassung und Bearbeitung dieser Daten steht eine zweite Folgemaske zur Verfügung.

Hinweis:

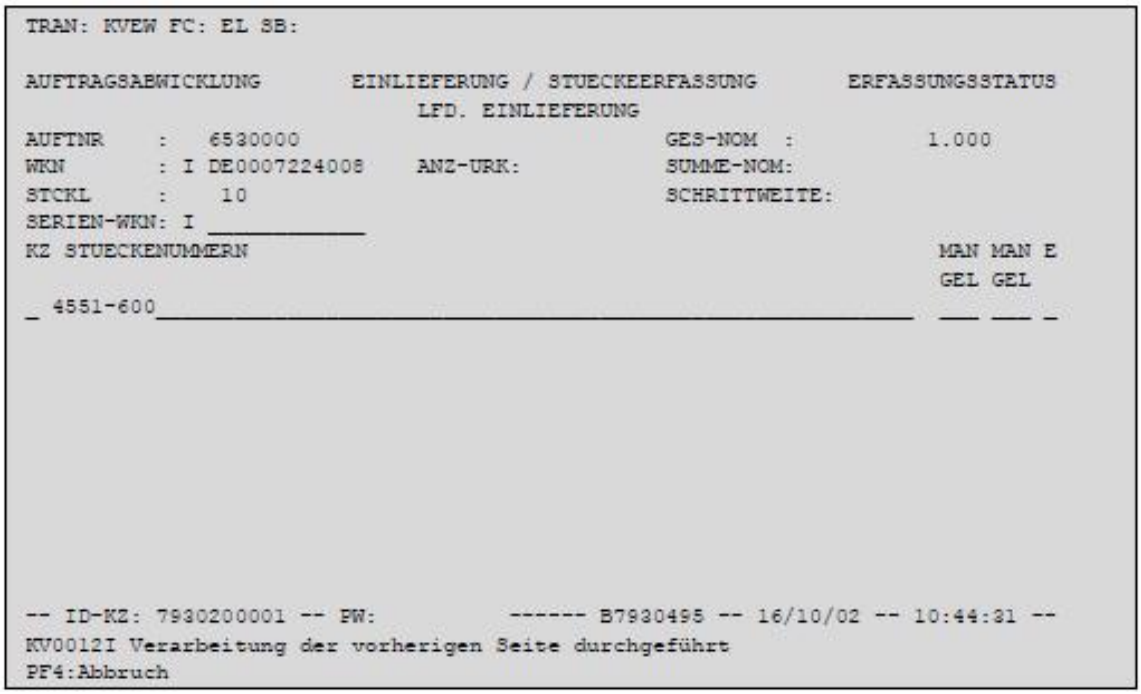
Die Eingabe und Bearbeitung der Stückenummern ist in Kapitel Stückenummern auf Seite 10-1 detailliert beschrieben. Innerhalb der Erfassung der Stückenummern muss bei wechselnder

- Stückelung
- Schrittweite und/oder

die Bildschirmseite gewechselt werden.

Vor diesen Wechseln müssen die bereits erfassten Daten mit der Taste PF6 abgespeichert werden.

(B) Folgemaske Stückenummern für Einzelurkunden



Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"L" - Löschung einer Stückenummer/Nummernfolge

"N" - Änderung einer Stückenummer

"M" - Änderung der Mängelgründe von Stückenummern/Nummernfolgen

"E" - Ersatzurkunde

Stückenummern - Oppositionsprüfung

Aufträge, die im CASCADE-Erfassungs- bzw. Auftragsstatus stehen, unterliegen täglich zusätzlich einer abendlichen Oppositionsprüfung. Dabei kann es passieren, dass eine Stückenummer in einem Auftrag als oppositionsbelegt gefunden wird. Beim Aufruf der auftragsrelevanten Daten eines solchen Auftrages informiert CASCADE, um wie viele oppositionsbelegte Stücke es sich handelt. In diesem Stadium kann der Auftrag nicht kontrolliert werden. Über die Informationsdienste können die entsprechenden Stückenummern ermittelt und danach über die Änderungsfunktion bearbeitet werden.

Darüber hinaus werden alle mit Opposition belegten Stücke, die sich im CASCADE-Erfassungsstatus befinden bzw. aus dem Auftragsstatus dorthin generiert wurden, in einer Oppositionsliste ausgewiesen.

Die Kennzeichnung einer Stückenummer als Ersatzurkunde ist nur möglich, wenn zu diesem Stück keine Oppositionsmeldung oder eine Meldung mit Oppositionsgrund 3 (Kraftloserklärung Aufgebot) vorliegt. Anderenfalls (Meldung mit Oppositionsgrund ungleich 3) wird die Eingabe eines "E" mit entsprechendem Fehlerhinweis abgelehnt. Über die tägliche abendliche Oppositionsverarbeitung können Stückenummern aus Einlieferungsaufträgen aufgrund neuer Meldungen nachträglich mit Oppositionen gekennzeichnet werden Handelt es sich bei dem eingelieferten Stück jedoch tatsächlich um die Ersatzurkunde, so kann dies über die Änderungsfunktionen korrigiert werden, sofern die Stückenummer mit Oppositionsgrund C belegt ist. Durch Eingabe eines "M" im Feld KZ und "E" wird diese Oppositionskennzeichnung der Stückenummer zurückgenommen und das Kennzeichen für Ersatzstück eingestellt.

War der Einlieferungsauftrag zum Zeitpunkt der Oppositionsverarbeitung bereits gebucht, dann besteht diese Möglichkeit jedoch nicht mehr. Der Auftrag kann nur noch gelöscht oder durch CBF vereinnahmt werden, wobei die Oppositionsstücke auch nach CARAD übergeleitet werden.

Stückenummern, bei denen CASCADE feststellt, dass sie bereits (doppelt) erfasst sind, werden mit dem Hinweis abgelehnt, dass systemseitig eine Suche veranlasst wird. In diesem Fall unterrichtet der Kunde die CBF per FAX über Gattung, Stückelung und Stückenummern. Bei einem Urkundenumtausch erfolgt die endgültige Prüfung auf doppelte Stückenummern bei der CBF.

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der Stückenummern zu einer Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d.h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
SCHRITTWEITE	Beim ersten Einstieg mit 1, ansonsten wird sie aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen.
STÜCKELUNG	Wird aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung von Stücke-Besonderheiten für eine Wertpapiereinlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
AUFTRAGSNR	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
MANGEL 1	Die Angabe von Oppositionsgründen ist nicht möglich.
MANGEL 2	Die Angabe von Oppositionsgründen ist nicht möglich.
ERSATZSTÜCK	Es kann "E" für Ersatzstück eingegeben werden
STÜCKELUNG	Sind Stückenummern mit Litera-Kennung zu erfassen, so ist diese in dem dafür vorgesehenen Bereich im Feld "Stückelung" einzugeben. Dabei sind maximal 10 Stückelungen pro Auftrag zulässig. In CASCADE werden die Stückelungen automatisch in absteigender Reihenfolge gespeichert. Die Einlieferung der zugehörigen Urkunden muss dieser Vorgabe entsprechen. Innerhalb einer Stückelung ist die Reihenfolge der Eingabe maßgebend.
SUMME-NOM	Wird mit der Nominale der bereits insgesamt erfassten Stücke belegt.
SCHRITTWEITE	Es können auf einer Maske nur Stückenummern mit derselben Schrittweite erfasst werden.
FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN	Die Eingabe der Stückenummern muss in der Reihenfolge vorgenommen werden, in der die Urkunden bei der CBF effektiv eingeliefert werden außer bei Verbundnummern. Spitzen mit mehr als 99 Stückenummern werden vom System als "100er-Päckchen" mit "Punkt/Stern" angezeigt. Namen und Bezeichnungen, die die Stückenummern beschreiben (z. B. "Nr."), gehören nicht zur Stückenummerneingabe. Die Angabe von führenden Nullen ist möglich, aber nicht zwingend. Trennungszeichen wie Blank (" "), Komma (,), Bindestrich (-), Hochkomma ('), Schrägstrich (/) innerhalb einer Stückenummer auf der Urkunde sind nicht anzugeben. Bei Nummernkreisen und Globalurkunden darf die Bis-Nr. nur aus dem Teil der Nummer bestehen, der sich von der Von-Nr. unterscheidet.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

STÜCKELUNG/VERWAHR-MÖGLICHKEIT

Für alle Verwahrarten, ausgenommen

- Eingeschränkte Girosammelverwahrung, Interimistische Globalurkunde (IGL)
- Eingeschränkte Girosammelverwahrung Einzelurkunden
- Eingeschränkte Girosammelverwahrung Dauerglobalurkunde (SVG)

gilt, dass die eingegebene Stückelung zur Wertpapierkennnummer mit der eingegebenen Litera vorhanden sein muss. Handelt es sich bei der Einheit der Effektennotiz um % oder ‰, dann wird die Stückelung- Nominale geprüft.

MANGEL 1/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Mangel 1 kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

MANGEL 2/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Mangel 2 kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

MANGEL 1/MANGEL 2

Bei Eingabe von Mangel 1 und Mangel 2 in einer Textzeile müssen die Inhalte der beiden Mängel unterschiedlich sein.

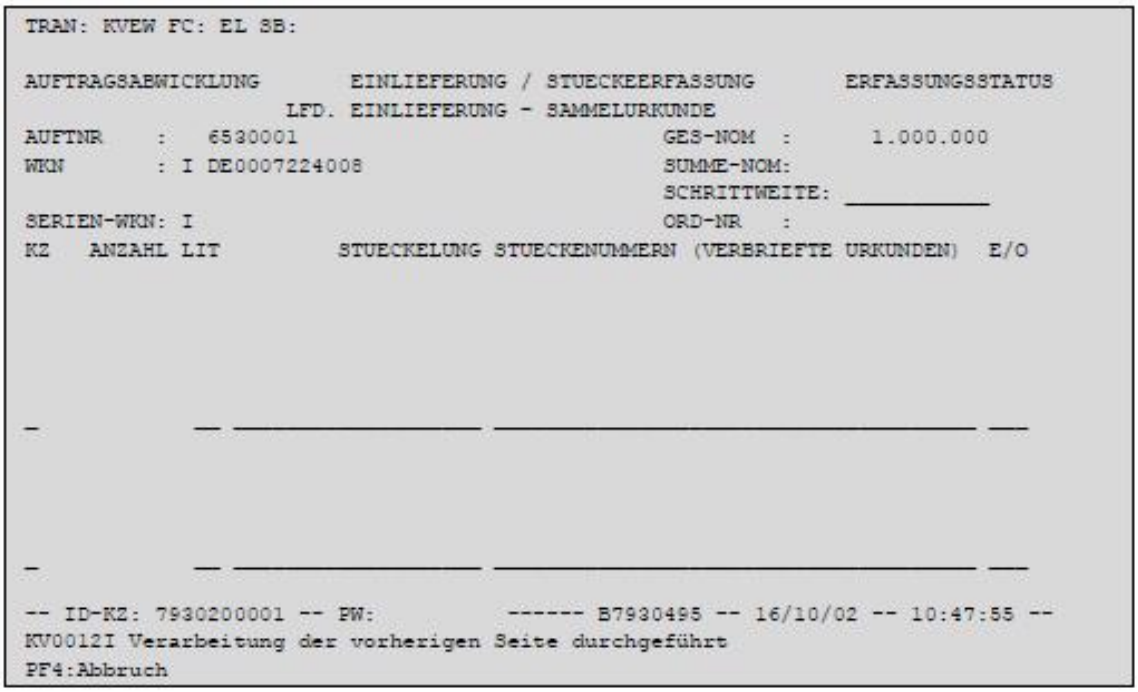
ERSATZSTÜCK/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Ersatzstück kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

ERSATZSTÜCK/WKN/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Handelt es sich bei der eingegebenen WKN/ISIN um ein Bezugsrecht, so ist die Kennzeichnung als Ersatzstück nicht erlaubt. Wird auf der Folgemaske wertpapierrelevanter Daten im Feld Sammelurkunde “J” eingegeben, wird folgende Maske angezeigt:

(E) Folgemaske Stückenummern für technische Sammelurkunden


TRAN: KVEW FC: EL SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG EINLIEFERUNG / STUECKEERFASSUNG ERFASSUNGSSTATUS
LFD. EINLIEFERUNG - SAMMELURKUNDE
AUFTNR : 6530001 GES-NOM : 1.000.000
WKN : I DE0007224008 SUMME-NOM:
SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN: I ORD-NR :
KZ ANZAHL LIT STUECKELUNG STUECKENUMMERN (VERBRIEFTE URKUNDEN) E/O
-- ID-KZ: 7930200001 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 10:47:55 --
KV0012I Verarbeitung der vorherigen Seite durchgeführt
PF4:Abbruch

Das Feld E/O ist in den Erfassungs- und Änderungsfunktionen für die Eingabe der Ersatzstückkennzeichnung vorgesehen. Die Plausibilitäten für die Einlieferung von Ersatzstücken bei Sammelurkunden stimmen mit denjenigen für Einzelurkunden überein.

Hinweis:

Die Eingabe und Bearbeitung der Stückenummern ist in Kapitel Die Stückenummern, detailliert beschrieben. Pro CASCADE-Auftrag kann nur eine Sammelurkunde eingegeben werden. Die Eingabe von Stückenummern bei der lfd. Einlieferung von technischen Sammelurkunden ist nicht zwingend, wenn es sich bei der WKN/ISIN um ein Wertpapier der Wertpapierklasse "I" Fonds handelt. In allen anderen Fällen müssen Stückenummern eingegeben werden.

Die Ordnungsnummer dient zur eindeutigen Identifikation von Sammelurkunden und kann für Sammel-Urkunden eingegeben werden.

12.1.4 Änderung Kennzeichen SAMMELURKUNDE (J/N)

Wenn innerhalb eines Einlieferungs-Auftrages irrtümlich eine Sammelurkunde anstelle von Einzelurkunden (oder umgekehrt) erfasst wurde, dann ist es möglich, das Kennzeichen SAMMELURKUNDE J/N zu ändern, ohne den gesamten Auftrag löschen zu müssen. Um dieses Kennzeichen ändern zu können, ist es allerdings erforderlich, zuerst die erfassten Stückenummern bzw. die ggfs. erfasste Ordnungsnummer zu löschen. Nach erfolgter Änderung des Kennzeichens können die Stückenummern dann direkt wieder erfasst werden.

12.2 Erfassung Neuzulassung/Valutierung (NV)

Für Gattungen mit folgenden Verwahrmöglichkeiten ist eine Neuzulassung mit und ohne gleichzeitiger Valutierung möglich:

- Interimistische Globalurkunde als Rahmenurkunde (BIS-ZU)
- Dauer-Globalurkunde als Rahmenurkunde (BIS-ZU)
- Technische Globalurkunde als Rahmenurkunde (BIS-ZU)
- Jungschein (BIS-ZU)

Die Daten für eine zu erfassende Neuzulassung/Valutierung in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- weitere wertpapierrelevante Folgedaten (Folgemaske 1)
- Stückenummern (Folgemaske 2) für Sammelurkunden

Nach Eingabe des Funktionscodes 'NV' in das Erfassungs-Auswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt.

12.2.1 Berechtigungsprüfung bei Valutierung

Bei Valutierung wird systemseitig geprüft, dass auf der Kundenseite nur die Bank (Kontostamm) angegeben wird, die als emissionsbegleitendes Institut bzw. Zahlstelle der Gattung zugelassen ist. Gleichzeitig muss die auf der Kundenseite angegebene Bank Erfasser des Auftrags sein. Die Valutierungen, für die die Berechtigungsprüfung relevant ist, sind durch die Wertpapiergruppen festgelegt.

Diese Wertpapiergruppen sind der Tabelle "Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung" aus dem Anhang zu entnehmen

Auswirkungen:

- Bei Erfassung/Änderung/Kontrolle/LIMA-Einstellung/Überleitung einer Valutierung wird geprüft, ob die Bank auf der Kundenseite als "Emissionsbegleitendes Institut" im WP-Stamm in WSS eingetragen ist. Ist das Feld leer, wird gegen die Zahlstelle geprüft. Falls die Bank weder als "Emissionsbegleitendes Institut" noch als Zahlstelle hinterlegt ist, führt dies zur Ablehnung des Auftrags im entsprechenden Bearbeitungsvorgang.
- Dabei ist zu beachten, dass auch die Clearstream berechtigt ist, für das emissionsbegleitende Institut bzw. für die Zahlstelle entsprechende Aufträge zu erfassen.

Falls von WM neue WP-Gruppen veröffentlicht werden, die nicht in der Tabelle Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung auf Seite -1 enthalten sind, dann werden Aufträge für Gattungen mit diesen WP-Gruppen automatisch für die "manuelle Bearbeitung durch die Prüfstelle" zugelassen.

In der Tabelle Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung auf Seite -1sind diejenigen WP-Gruppen enthalten, die nicht für Valutierung/Revalutierung zugelassen sind.

12.2.2 Autom. Buchungsfreigabe Valutierung

Valutierungen werden für bestimmte Gattungen zur Buchung nicht mehr standardmäßig von den CBF-Prüfstellen bearbeitet, sondern direkt mit der Kontrolle (Vollanzeige/Kurzanzeige) gebucht. Dies ist möglich, da für diese ebenfalls eine automatische Prüfung auf Berechtigung durchgeführt wird. Die Definition ist analog der für die Berechtigungsprüfung (Definition siehe entsprechendes Kapitel im Anhang).

Mit der automatischen Freigabe obliegt die genauere fachliche Prüfung der bearbeitenden Bank. Sollte diese erst nach der Buchung einen Fehler feststellen, gibt es zwei Möglichkeiten, die Falschbuchung wieder rückgängig zu machen:

- Zum einen kann die Bank sich mit CBF in Verbindung setzen, damit durch CBF ein entsprechender Storno veranlasst wird. Verbunden mit einem Storno über die Auftragsart 99 ist die manuelle Korrektur des CARAD-Bestandes (Verminderung/Erhöhung der Nominale mit ggf. Neuerfassung der Stückenummern).
- Zum anderen kann die Bank selbst einen Gegenauftrag erteilen oder durch CBF erteilen lassen. Bei der Korrektur einer falsch gebuchten Valutierung mit Stücken mittels Revalutierung kann allerdings kein Anspruch darauf erhoben werden, dass die gleichen Stückenummern ausgeliefert werden, die fälschlicherweise eingeliefert wurden.

In der Disposition abgelehnte Valutierungen werden nach 90 BA, fällige Revalutierungen nach 40 BA aus dem Auftragsstatus gelöscht, sofern diese Aufträge noch keine Eingangsbuchnummer erhalten haben. Die Valutierungsaufträge werden für Gattungen, die für die automatische Buchungsfreigabe zugelassen sind, mit der Kontrolle direkt in die Buchung eingestellt.

12.2.3 Untertägige Tresorvereinnahmung und automatische Überleitung in den Kontrollierten CARAD Bestand

Es werden untertägig alle zwei Stunden folgende Prozesse durchgeführt werden:

1. Automatische Vereinnahmung
   a. aller EDT-Aufträge
   b. aller bis zum Intervallzeitpunkt gebuchten und noch nicht vereinnahmten Aufträge "autom. Valutierungen" von Sammelurkunden ohne Stückenummern.
   Ausführung: alle zwei Stunden, ca. 07:20-17:20 Uhr
2. Automatische Überleitung nach CARAD/Endbearbeitung
   a. aller bis zum Intervallzeitpunkt automatisch oder manuell vereinnahmten Einlieferungsaufträge ohne Stückenummern.
   Ausführung alle zwei Stunden, ca. 08:20 -16:20 Uhr
   b. aller bis zum Intervallzeitpunkt automatisch oder manuell vereinnahmten "autom. Valutierungen" von Sammelurkunden ohne Stückenummern.
   Ausführung: direkt nach Vereinnahmung (Punkt 1b)

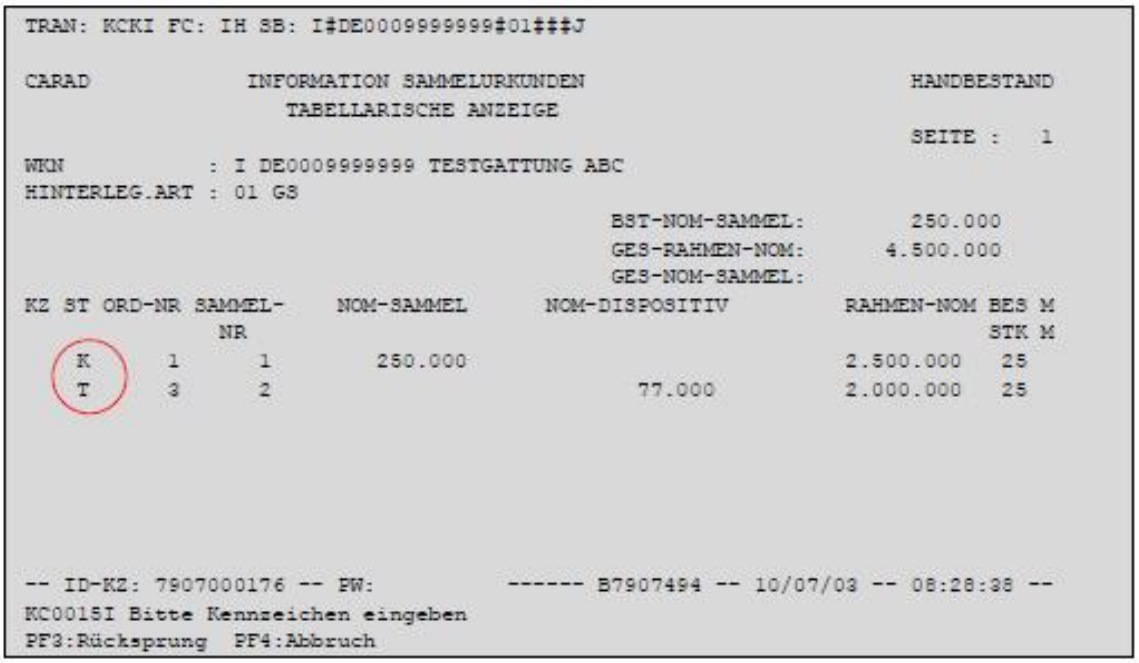
12.2.4 Neuzulassung Rahmenurkunde mit gleichzeitiger Valutierung

Für die Neuzulassung einer Rahmenurkunde mit gleichzeitiger Valutierung (Einlieferungsart 4) erfolgt noch keine Berechtigungsprüfung auf Hauptzahlstelle/emissionsbegleitendes Institut, da zu diesem Zeitpunkt die Hauptzahlstelle oder das emissionsbegleitende Institut unter Umständen noch nicht feststeht. Wenn diese Urkunde allerdings erneut valutiert/revalutiert werden soll, greift die Berechtigungsprüfung sofort.

Hinweis:

Wenn eine Rahmenurkunde mit der Einlieferungsart 4 "Neuzulassung Rahmenurkunde mit Valutierung" bei CBF eingeliefert wird, ist eine erneute Valutierung/Revalutierung erst möglich, wenn der Auftrag mit der Neuzulassung im CBF-Tresor vereinnahmt wurde, d. h. die Urkunde muss den Status "K – Kontrolliert" erreicht haben. Mittels der Transaktion KCKI IH (CARAD-Kundeninformation) können die Kunden den Status der Urkunden überprüfen, wenn sie für diese Gattung als Hauptzahlstelle oder emissionsbegleitendes Institut bei CBF eingetragen sind.

Tabellarische Anzeige in KCKI


TRAN: KCKI FC: IH SB: I#DE0009999999#01###J
CARAD INFORMATION SAMMELURKUNDEN HANDBESTAND
TABELLARISCHE ANZEIGE
SEITE : 1
WKN : I DE0009999999 TESTGATTUNG ABC
HINTERLEG.ART : 01 GS
BST-NOM-SAMMEL: 250.000
GES-RAHMEN-NOM: 4.500.000
GES-NOM-SAMMEL:
KZ ST ORD-NR SAMMEL- NOM-SAMMEL NOM-DISPOSITIV RAHMEN-NOM BES M
NR STK M
K 1 1 250.000 2.500.000 25
T 3 2 77.000 2.000.000 25
-- ID-KZ: 7907000176 -- PW: ------ B7907494 -- 10/07/03 -- 08:28:38 --
KC0015I Bitte Kennzeichen eingeben
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Urkunden im Status "T – Teilerfasst" sind bei CBF gebucht, aber noch nicht vom Tresor vereinnahmt. Die Nominale der Valutierung wird daher auch noch als dispositive Nominale aufgeführt. Nach erfolgter Vereinnahmung durch den CBF-Tresor geht die Urkunde im nachfolgenden Batch über Nacht in den Status "K" über und die NOM-DISPOSITIV wird nach NOM-SAMMEL überführt. Erst jetzt ist eine erneute Valutierung/Revalutierung möglich.

Die Beschreibung der Transaktion KCKI entnehmen Sie bitte dem Benutzerhandbuch CARAD User Manual.

TIPP:

Wenn bereits absehbar ist, dass am selben Arbeitstag neben der Neuzulassung einer Rahmenurkunde diese mehrfach valutiert oder revalutiert werden soll, dann empfehlen wir Ihnen, die Neuzulassung in der Einlieferungs-Art "3 – Neuzulassung Rahmenurkunde" mit der Rahmennominale "0" vorzunehmen und die anschließenden Valutierungen in der Einlieferungs-Art "5 – Valutierung". 'Auf diese Weise sind alle Aufträge am selben Arbeitstag zu erfassen und zu buchen.

12.2.5 Buchungsrelevante Auftragsdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Auftrag in CASCADE buchen zu können.

(B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten

```
TRAN: KVEW FC: NV SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG       ERFASSUNGSSTATUS
                             NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG
PRIMANOTE:  653           AUFTNR:    653001        HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 200       CBF TR. B. GS -TGL BIS-ZU-
GUT-KTO  : 7999 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0005151005 BASF SE O.N.

NOMINALE :          10.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          10.000          EINLIEF-ART  : 4   NEUZULASSUNG VAL. RU
RAHMEN-NOM:           10.000        ORD-NR       :      1
                                    EINLIEF-GRUND:   1 AUS EMISSION
KUNDENREFERENZ       :     -                 -                    KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:

BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST


-- ID-KZ: 7999230003 -- PW:          ------ B7907497 -- 08/07/08 -- 11:23:59 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:	Beschreibung
AUFTRNR		
HLG	"01" (GS)	Girosammelverwahrung HLG 99 ist nicht zugelassen
EINLIEF-ART	"2"	Neuzulassung Globalurkunde
LAST-KTO	CBF interne Kontonummer	Tresorkontonummer
GUT-KTO	Bank-Nr.	Hauptkonto der erfassenden Bank
WKN-KENNUNG	"I"	ISIN
WKN		
NOMINALE	Buchungsnominale	
NOM-URK	Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung	
RAHMEN-NOM		Bei der Neuzulassung von Rahmenurkunden muss eine Rahmen-Nominale eingegeben werden.

Feld	vorbelegt mit:	Beschreibung
ORD-NR	Vorbelegung mit "1"nur für EDT Kunden	Bei der Neuzulassung von Rahmenurkunden via EDT-Prozess wird die Ordnungsnummer mit "1" vorbelegt.
SET-DAY	Aktuellen Datum	Es ist möglich, den Settlement-Day bei Neuzulassungen und Valutierungen in der CASCADE Transaktion KVEW - NV (NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG) bis zu 40 Bankarbeitstage im Voraus anzugeben.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für die Neuzulassung/Valutierung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Kunden (Eingeber) darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den CBF internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
GUT-KTO	Niederlassungen können nur Einlieferungen zugunsten der Zentrale tätigen. Kunden ohne Bestandsführung können keine Ersteinlieferungen tätigen.
NOMINALE NOM-URK	Die Eingabe 0 ist in bestimmten Vorgängen erlaubt (z. B. Neuzulassung Rahmenurkunde)
SET-DAY	Das Feld "SET-DAY" muss immer gefüllt sein (Eingabe Pflicht Feld) und wird standardmäßig mit dem aktuellen Tagesdatum vorbelegt. Der vorbelegte Settlement-Day kann mit einem Datum, das bis zu 40 Bankarbeitstage in der Zukunft liegt, von den CBF-Teilnehmern überschrieben werden. Prüfungen bei Auftragserteilung gegen CARAD (z. B.: bei Valutierungen auf vorhandene Ordnungsnummer) werden nur noch für Aufträge ausgeführt deren Settlement-Day dem aktuellen Arbeitstag entspricht. Das neue Eingabe-Feld "SET-Day" wird in allen relevanten Informationsanzeigen (CASCADE Erfassungs-, Auftrags- und Dispositionsstatus) sowie in den Online-Druckreports übernommen.
WKN	In einem Auftrag bzw. einer Einlieferung können nur Urkunden einer Wertpapierkennnummer zusammengefasst werden. Optionsanleihen-cum können zurzeit nicht elektronisch in Auftrag gegeben werden.

Mögliche Eingaben:

EINLIEF-ART:

Maske	Beschreibung
2	Neuzulassung Globalurkunde
3	Neuzulassung Rahmenurkunde
4	Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde
5	Valutierung

EINLIEF-GRUND:

Maske	Beschreibung
001	aus Emission
002	KE gegen Einlage
003	Kapitalerhöhung bedingt – Optionsscheinausübung-
004	Rahmenurkunde Ersteinlieferung RS
005	Urkundenumtausch
007	Gratisaktien

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST-KTO/GUT-KTO

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

GUT-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen. Es erfolgt u. U. eine Berechtigungsprüfung gegen WSS.

GUT-KTO/EINLIEF-GRUND

Handelt es sich beim Gut-Konto um ein Konto für die Einlieferung aus Aktien aus Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln, dann sind nur die Einlieferungsgründe 1 (Neuemission), 2 (unbedingte KE) und 7 (bedingte KE) erlaubt.

Folgende kombinierte Eingaben von WKN/ISIN und Einlieferungsgrund sind möglich:

- bei Einlieferungsgrund = 1 sind WKN/ISIN mit allen erlaubten Verwahrmöglichkeiten zugelassen, außer RS
- bei Einlieferungsgrund = 2 oder 3 sind nur für RS-Aktien erlaubt.
- bei Einlieferungsgrund = 4 (Einlieferung von RS vor dem GS-Stichtag) sind nur RS erlaubt.
- bei Einlieferungsgrund = 5 (Urkundenumtausch) sind alle WKN/ISIN erlaubt.
- bei Einlieferungsgrund = 7 (Erstbelieferung) sind WKN/ISIN mit den Verwahrmöglichkeiten JGS bis Einlieferung; SVG Inhabersammelzertifikat CBF und Miteigentum Sh.Cert. erlaubt.

NOMINALE/EINLIEF-GRUND

Wird die Nominale mit 0 belegt (Neuzulassung einer Rahmenurkunde), dann sind nur die Einlieferungsgründe 1 (aus Emission), 3 (bedingte KE) und 4 (Einlieferung von RS) erlaubt.

NOMINALE/EINLIEF-ART/STUECKENUMMERN/ORD-NR

- Wenn Einlieferungs-Art = 2,
  - Nominale muss größer 0 sein
  - Rahmennominale muss gleich 0 sein
  - Stückenummern können eingegeben werden
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und darf noch nicht in CARAD vorhanden sein
- wenn Einlieferungs-Art = 3
  - Nominale muss gleich 0 sein
  - Rahmennominale muss größer 0 sein
  - es dürfen keine Stückenummern eingegeben werden
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und darf noch nicht in CARAD vorhanden sein
- wenn Einlieferungs-Art = 4
  - Nominale muss größer 0 sein, aber maximal gleich Rahmennominale
  - Rahmennominale muss größer 0 sein
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und darf noch nicht in CARAD vorhanden sein
  - Stückenummern müssen eingegeben werden, wenn es sich um eine RS-Gattung handelt, sonst können diese eingegeben werden
- wenn Einlieferungs-Art = 5
  - Nominale muss größer 0 sein
  - Rahmennominale muss gleich 0 sein
  - Stückenummern müssen eingegeben werden, wenn es sich um eine RS-Gattung handelt, ansonsten können diese eingegeben werden
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und muss schon in CARAD vorhanden sein

LAST-KTO/HLG

Wenn das Lastkonto die Kontoart 261 hat, ist nur HLG 20 erlaubt und umgekehrt.

NOMINALE/NOM-URK

Wird das Feld Nominale-Urkunde gefüllt, wird systemseitig das Feld Nominale ermittelt und gefüllt. Werden beide Felder gefüllt, werden systemseitig die Inhalte geprüft.

WKN/EINLIEF-ART/EINLIEF-GRUND

- Wenn Einlieferungs-Art = 2 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2 und 7 zugelassen
- wenn Einlieferungs-Art = 3 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2, 3, 4, 5, 7 zugelassen
- wenn Einlieferungs-Art = 4 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2, 3, 5, 7 zugelassen
- wenn Einlieferungs-Art = 5 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2, 3, 7 zugelassen.

WKN/NOMINALE

Für bestimmte WKN/ISIN GS-Verwahrmöglichkeiten kann eine Rahmenurkunde und somit als Nominale 0 eingegeben werden.

WKN/HLG

Handelt es sich bei der WKN/ISIN um eine Namensaktie (RS), dann ist nur die Hinterlegungsart 'Girosammelverwahrung' (01) erlaubt. Handelt es sich nicht u eine RS-Gattung, dann gelten folgende Abhängigkeiten:

- Wenn HLG 1, dann sind VWM 96-98 nicht erlaubt

WKN/RAHMEN-NOM

Wenn es sich bei der WKN/ISIN um eine EDT-Urkunde handelt, dann muss die Rahmen-Nominale gefüllt sein.

WKN/ORD-NR

Wenn es sich bei der WKN/ISIN um eine EDT-Urkunde handelt, dann wird die Ordnungsnummer mit "1" vorbelegt. Sollte diese Ordnungsnummer für diese WKN/ISIN schon in CARAD vorhanden sein, dann muss

12.2.6 Wertpapierrelevante Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Für die korrekte Bearbeitung und Abwicklung einer Neuzulassung/Valutierung müssen neben den buchungsrelevanten Informationen noch weitere wertpapierspezifische Daten im Auftrag erfasst werden. Dazu wird nach der Verarbeitung der buchungsrelevanten Auftragsdaten auf eine Folgemaske verzweigt.

(B) Folgemaske wertpapierrelevanter Daten

```
TRAN: KVEW FC: NV SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / FOLGEERFASSUNG        ERFASSUNGSSTATUS
                              NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG
AUFTNR:        16                                  WKN:  I DE0005151005
                                                   HLG: 01 GS
VERWAHR-MOEGLICHKEIT    :   9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            :  22 TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (LIEFERBAR)
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG :   0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :         21              LETZT. KUPON  :         41


NACHWEISART:   1 EINLIEF. EFF. URK.

KE-TYP
WKN DES RECHTS: I
EX-TAG/BEGINN :                                 DATUM-KE      :

TEXT:

-- ID-KZ: 7999260001 -- PW:          ------ B79075XC -- 30/09/02 -- 15:24:44 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Vor  PF7:Zurück
```

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich.

Feld	vorbelegt mit:
PRIMANOTE	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
AUFTRAGSNR	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
HLG	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
NACHWEISART	1 - Einlieferung effektiver Urkunden (Kennzeichen für „Nicht-EDT-Urkunden“) 8 - Einlieferung EDT (Kennzeichen für „EDT-Urkunden“)

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten für eine Einlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
NÄCHSTER KUPON/NÄCHSTER LEG-SCHEIN	Die Eingabe für dieses Feld wird gegen die zum Wertpapier gespeicherten Informationen geprüft und entsprechend belegt. Bei Renten erfolgt eine Datumsprüfung, bei Aktien erfolgt eine numerische Prüfung. Handelt es sich beim nächsten Kupon um ein Bezugsrecht, ist die Eingabe eines Datums oder einer max. dreistelligen Nummer möglich. Bei Optionsscheinen wird der nächste Legitimationsschein gefordert (alphanumerische Eingabe).

(D) Abhängigkeitsprüfungen

DATUM-KE/EINLIEF-GRUND

Wenn DATUM-KE gefüllt ist, dann muss EINLIEF-GRUND 2, 3, 7 sein, unabhängig von der EINLIEF-ART.

VWM/EINLIEF-ART/BESONDERHEIT

Bei der Auftragserteilung von Neuzulassungen über die CASCADE-Transaktion KVEW NV wird das Feld “Besonderheit” unter den unten aufgeführten Bedingungen vorbelegt.

- Bei Valutierungen (Einlieferungsart 5) ist das Feld nicht eingebbar und wird auch nicht vorbelegt.
- Globalbonds (KV-Lagerland = 998) werden mit der Besonderheit 57 "Globalbonds ohne Bogen" vorbelegt.
- RS-Gattungen werden je Verwahrmöglichkeit wie folgt mit der Besonderheit vorbelegt:
  - VWM 14: Vorbelegung mit Besonderheit 55 "Rahmenurkunde ohne Bogen"
  - VWM 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 "IGL ohne Bogen"
  - VWM 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 "technische Globalurkunde ohne Bogen lieferbar"
- TEFRA D Anleihen werden mit der Besonderheit 55 "Rahmenurkunde ohne Bogen" vorbelegt.
- Für Lieferungen in der Einlieferungsart 2 gilt folgende Regeln:
  - VWM 1, 2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 "Jungschein ohne Bogen"
  - VWM 5: Vorbelegung mit Besonderheit 48 "IGL ohne Bogen"
  - VWM 9, 16: Es erfolgt keine systemseitige Vorbelegung. Das Feld Besonderheiten wird durch die CBF Prüfstelle ergänzt.
- Sonstige VWM: Vorbelegung mit Besonderheit 53 "Dauerglobalurkunde ohne Bogen"
- Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 unterliegen folgenden Regeln:
  - VWM 9, 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 "technische Globalurkunde ohne Bogen"
  - VWM 1,2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 "Jungschein ohne Bogen"
  - VWM 5, 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 "IGL ohne Bogen"

Ausnahmen sind WKN/ISIN mit den Stückearten "Nur Mantel" und "Unikat". Bei WKN/ISIN mit der Stückart "Nur Mantel" können die Besonderheiten 21 und 23, bei WKN/ISIN mit der Stückeart "Unikat" können die Besonderheiten 20 und 22 eingegeben werden. Für RS-Gattungen sind nur die Besonderheiten 5 und 6 erlaubt.

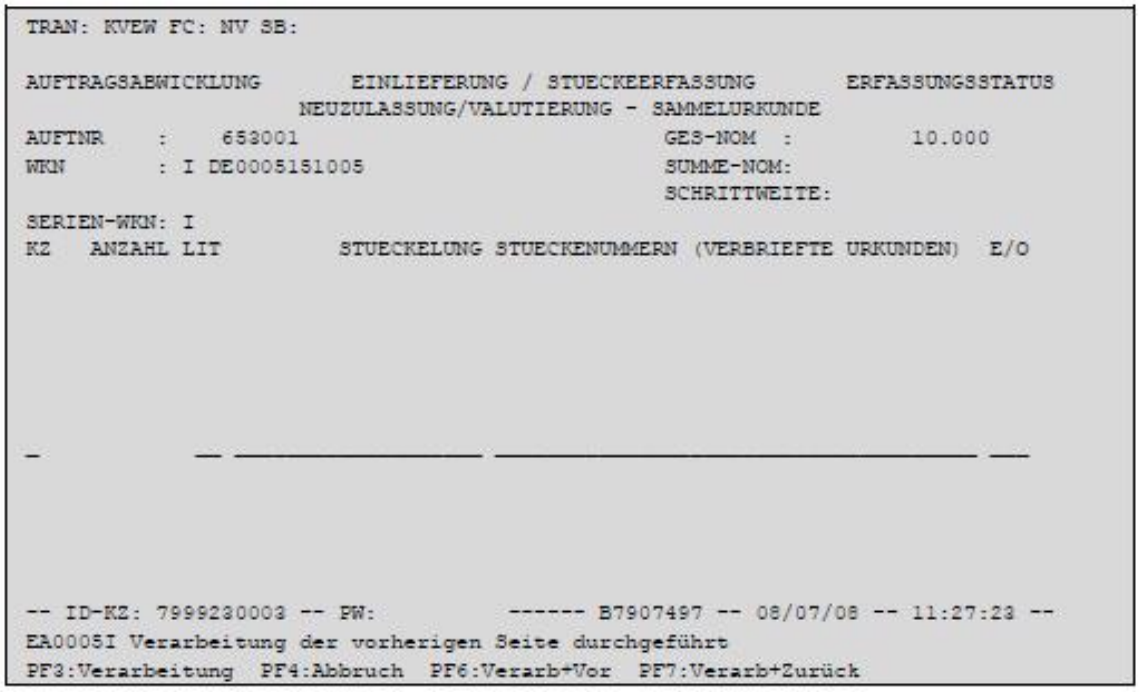
Für CBF-Kunden, die zur Auftragserteilung den EDT-Services (Premium) nutzen und somit keine Möglichkeit der Spezifizierung von Besonderheiten haben, wird gemäß den o.a. Bedingungen vorbelegt.

12.2.7 Stückenummern Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Zur vollständigen Auftragserteilung ist es notwendig, die zugehörigen Stückenummern der einzuliefernden Urkunden im Auftrag anzugeben. Zur Erfassung und Bearbeitung dieser Daten steht eine zweite Folgemaske zur Verfügung.

(B) Folgemaske Stückenummern


TRAN: KVEW FC: NV SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG EINLIEFERUNG / STUECKEERFASSUNG ERFASSUNGSSTATUS
NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG - SAMMELURKUNDE
AUFTNR : 653001 GES-NOM : 10.000
WKN : I DE0005151005 SUMME-NOM:
SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN: I
KZ ANZAHL LIT STUECKELUNG STUECKENUMMERN (VERBRIEFTE URKUNDEN) E/O
-- ID-KZ: 7999230003 -- PW: ------ B7907497 -- 08/07/08 -- 11:27:23 --
EA0005I Verarbeitung der vorherigen Seite durchgeführt
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Vor PF7:Verarb+Zurück

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"L"	Löschung einer Stückenummer/Nummernfolge
"A"/"N"	Änderung einer Stückenummer
"M"	Änderung der Mängelgründe von Stückenummern/Nummernfolgen
"E"	Änderung Ersatzurkunde

Hinweis:

Die Eingabe und Bearbeitung der Stückenummern ist in Kapitel Stückenummern auf Seite 10-1 detailliert beschrieben. Innerhalb der Erfassung der Stückenummern muss jeweils bei neuer

- Stückelung
- Schrittweite und/oder

die Bildschirmseite gewechselt werden.

Vor diesen Wechseln müssen die bereits erfassten Daten mit der Taste PF6 abgespeichert werden.

Die Kennzeichnung einer Stückenummer als Ersatzurkunde ist nur möglich, wenn zu diesem Stück keine Oppositionsmeldung oder eine Meldung mit Oppositionsgrund 3 (Kraftloserklärung Aufgebot) vorliegt. Anderenfalls (Meldung mit Oppositionsgrund ungleich 3) wird die Eingabe eines "E" mit entsprechendem Fehlerhinweis abgelehnt.

Über die tägliche abendliche Oppositionsverarbeitung können Stückenummern aus Einlieferungsaufträgen aufgrund neuer Meldungen nachträglich mit Oppositionen gekennzeichnet werden. Handelt es sich bei dem eingelieferten Stück jedoch tatsächlich um die Ersatzurkunde, so

kann dies über die Änderungsfunktionen korrigiert werden, sofern die Stückenummer mit Oppositionsgrund C belegt ist.

Durch Eingabe eines "M" im Feld KZ und "E" im Feld E/O wird diese Oppositionskennzeichnung der Stückenummer zurückgenommen und das Kennzeichen für Ersatzstück eingestellt.

War der Einlieferungsauftrag zum Zeitpunkt der Oppositionsverarbeitung bereits gebucht, dann besteht diese Möglichkeit jedoch nicht mehr. Der Auftrag kann nur noch gelöscht oder durch CBF vereinnahmt werden, wobei die Oppositionsstücke auch nach CARAD übergeleitet werden.

Darüber hinaus werden alle mit Opposition belegten Stücke, die sich im CASCADE-Erfassungsstatus befinden bzw. aus dem Auftragsstatus dorthin generiert wurden, in einer Oppositionsliste ausgewiesen (siehe Kapitel Auswertungen auf Seite 23-1).

Bei Neuzulassung Globalurkunde ist eine Eingabe von Stückenummern nicht zwingend erforderlich, während bei Neuzulassung Rahmenurkunde nie Stückenummern eingegeben werden dürfen. Bei Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde müssen für RS-Gattungen Stückenummern eingegeben werden, sonst können diese eingegeben werden. Bei Valutierung müssen für RS-Gattungen Stückenummern eingegeben werden, sonst können diese eingegeben werden. Stückenummern, bei denen CASCADE feststellt, dass sie bereits (doppelt) erfasst sind, werden mit dem Hinweis abgelehnt, dass systemseitig eine Suche veranlasst werden muss. In diesem Fall unterrichtet der Kunde die CBF per FAX über Gattung, Stückelung und Stückenummer (siehe Kontakte auf Seite 2-1).

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der Stückenummern zu einer Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d.h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
SCHRITTWEITE	Beim ersten Einstieg mit 1, ansonsten wird sie aus der vorherigen Stücke- Erfassung übernommen.
STÜCKELUNG	Wird aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Kapitel Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung von Stücke-Besonderheiten für eine Wertpapiereinlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
AUFTRAGSNR	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
ERSATZSTÜCK	Es kann "E" für Ersatzstück eingegeben werden
STÜCKELUNG	Sind Stückenummern mit Litera-Kennung zu erfassen, so ist diese in dem dafür vorgesehenen Bereich im Feld 'Stückelung' einzugeben. Dabei sind maximal 10 Stückelungen pro Auftrag zulässig. In CASCADE werden die Stückelungen automatisch in absteigender Reihenfolge gespeichert. Die Einlieferung der zugehörigen Urkunden muss dieser Vorgabe entsprechen. Innerhalb einer Stückelung ist die Reihenfolge der Eingabe maßgebend.
SUMME-NOM	Wird mit der Nominale der bereits insgesamt erfassten Stücke belegt.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

STÜCKELUNG/VERWAHR-MÖGLICHKEIT

Für alle Verwahrarten, ausgenommen - Eingeschränkte GS-Verwahrung-:
gilt, dass die eingegebene Stückelung zur WKN/ISIN mit der eingegebenen Litera vorhanden sein muss. Handelt es sich bei der Einheit-der-Effektennotiz um % oder 0/00, dann wird die Stückelung-Nominale geprüft. Bei ST (Stücke) wird die Anzahl Stücke geprüft.

ERSATZSTÜCK/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Ersatzstück kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

ERSATZSTÜCK/WKN/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Handelt es sich bei der eingegebenen WKN/ISIN um ein Bezugsrecht, so ist die Kennzeichnung als Ersatzstück nicht erlaubt.

12.3 Erfassung von Aufträgen zur effektiven Auslieferung oder Revalutierung/Teilreduzierung von Emissionen (AL)

Folgende Aufträge werden hier erfasst:

- laufende Auslieferungen von Einzelurkunden mit (Einzel- und Verbundnummern) Stufe II
- laufende Auslieferungen von technischen Sammelurkunden
- laufende Auslieferungen als Umlegung aus oder in Vorratslager für nicht begebene Fondsanteile
- eingeschränkte GS-Verwahrung
- Revalutierung von Rahmenurkunden (mit oder ohne Auslieferung der Rahmenurkunde)
- Teilreduzierung von Globalurkunden
- Auslieferung von Rahmenurkunden ohne Revalutierung

Die Daten für einen zu erfassenden Auslieferungsauftrag in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- Adressdaten, Versand- und Versicherungsdaten
- Stückelungswünsche und Textzusätze für die Auslieferungsvorgänge 2 und 3 sowie Auslieferungsvorgang 1 und Sammelurkunde = N
- Urkundenwünsche und Textzusätze für den Auslieferungsvorgang 1 1 mit KZ-Sammelurkunde = J

12.3.1 Berechtigungsprüfung bei Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde

Bei Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde wird systemseitig geprüft, dass auf der Kundenseite nur die Bank (Kontostamm) angegeben wird, die als emissionsbegleitendes Institut bzw. Zahlstelle der Gattung zugelassen ist. Gleichzeitig muss die auf der Kundenseite angegebene Bank Erfasser des Auftrags sein.

Die Revalutierungen ohne Auslieferung Rahmenurkunde, für die die Berechtigungsprüfung relevant ist, sind durch die Wertpapier-Instrumentenarten festgelegt.

Diese Instrumentenarten sind der Tabelle “Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung” aus dem Anhang zu entnehmen

Auswirkungen:

- Bei Erfassung/Änderung/Kontrolle/LIMA-Einstellung/Überleitung einer Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde wird geprüft, ob die Bank auf der Kundenseite als “Emissionsbegleitendes Institut” im WP-Stamm in WSS eingetragen ist (siehe Schnittstellen). Ist das Feld leer, wird gegen die Zahlstelle geprüft. Falls die Bank weder als “Emissionsbegleitendes Institut” noch als Zahlstelle hinterlegt ist, führt dies zur Ablehnung des Auftrags im entsprechenden Bearbeitungsvorgang.
- Dabei ist zu beachten, dass auch die Clearstream berechtigt ist, für das emissionsbegleitende Institut bzw. für die Zahlstelle entsprechende Aufträge zu erfassen.

Falls von WM neue Instrumentenarten veröffentlicht werden, die nicht in der Tabelle Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung auf Seite -1 enthalten sind, dann werden Aufträge für Gattungen mit diesen WP-Gruppen automatisch für die “manuelle Bearbeitung durch die Prüfstelle” zugelassen.

In der Tabelle Definition der nicht zugelassenen Gattungen auf Seite -2 sind diejenigen WP-Gruppen enthalten, die nicht für Valutierung/Revalutierung zugelassen sind.

12.3.2 Autom. Buchungsfreigabe Revalutierung ohne Auslieferung

Revalutierungen ohne Auslieferung Rahmenurkunde werden für bestimmte Gattungen nicht standardmäßig von den CBF-Prüfstellen zur Buchung freigegeben, sondern direkt mit der Kontrolle (Vollanzeige/Kurzanzeige) gebucht. Dies ist möglich, da für diese ebenfalls eine automatische Prüfung auf Berechtigung durchgeführt wird. Die Definition ist analog der für die Berechtigungsprüfung (Definition siehe entsprechendes Kapitel im Anhang).

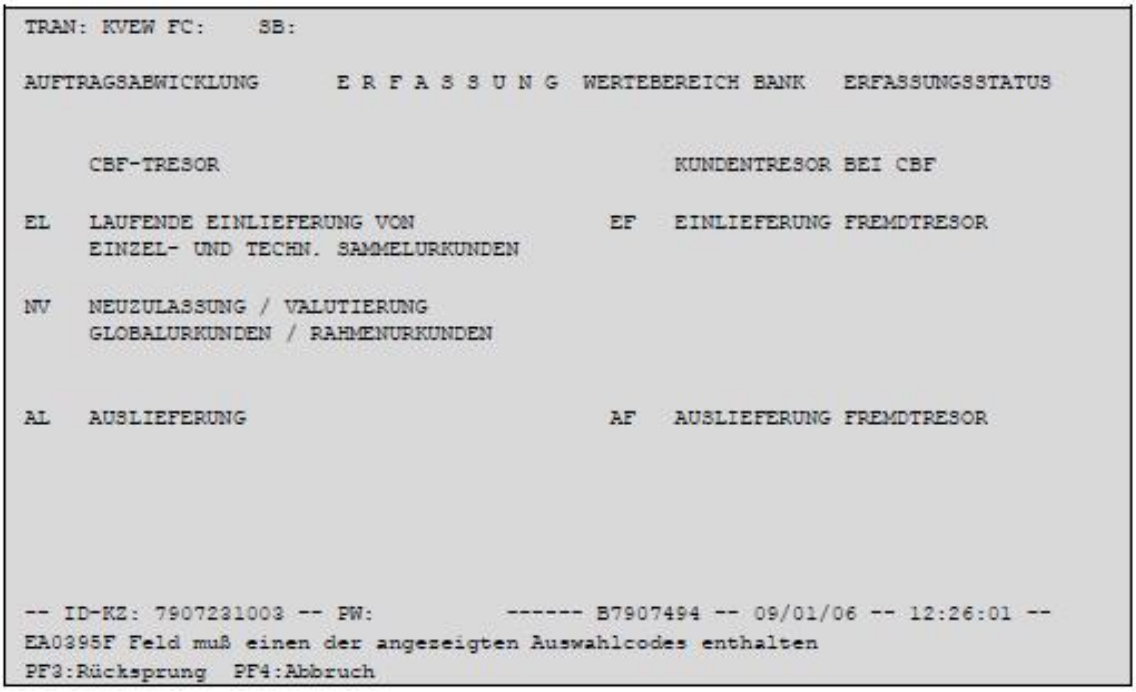
Mit der automatischen Freigabe obliegt die genauere fachliche Prüfung der bearbeitenden Bank. Sollte diese erst nach der Buchung einen Fehler feststellen, gibt es zwei Möglichkeiten die Falschbuchung wieder rückgängig zu machen. Zum einen kann die Bank sich mit CBF in Verbindung setzen, damit durch CBF ein entsprechender Storno veranlasst wird. Verbunden mit einem Storno über die Auftragsart 99 ist die manuelle Korrektur des CARAD-Bestandes (Verminderung/Erhöhung der Nominale mit ggf. Neuerfassung der Stückenummern).

Zum anderen kann die Bank selbst einen Gegenauftrag erteilen oder durch CBF erteilen lassen. Bei der Korrektur einer falsch gebuchten Revalutierung mit Stücken mittels Valutierung kann allerdings kein Anspruch darauf erhoben werden, dass die gleichen Stückenummern ausgeliefert werden, die fälschlicherweise disponiert wurden.

In der Disposition abgelehnte Valutierungen werden nach 90 BA, fällige Revalutierungen nach 40 BA aus dem Auftragsstatus gelöscht.

12.3.3 Buchungsrelevante Auftragsdaten

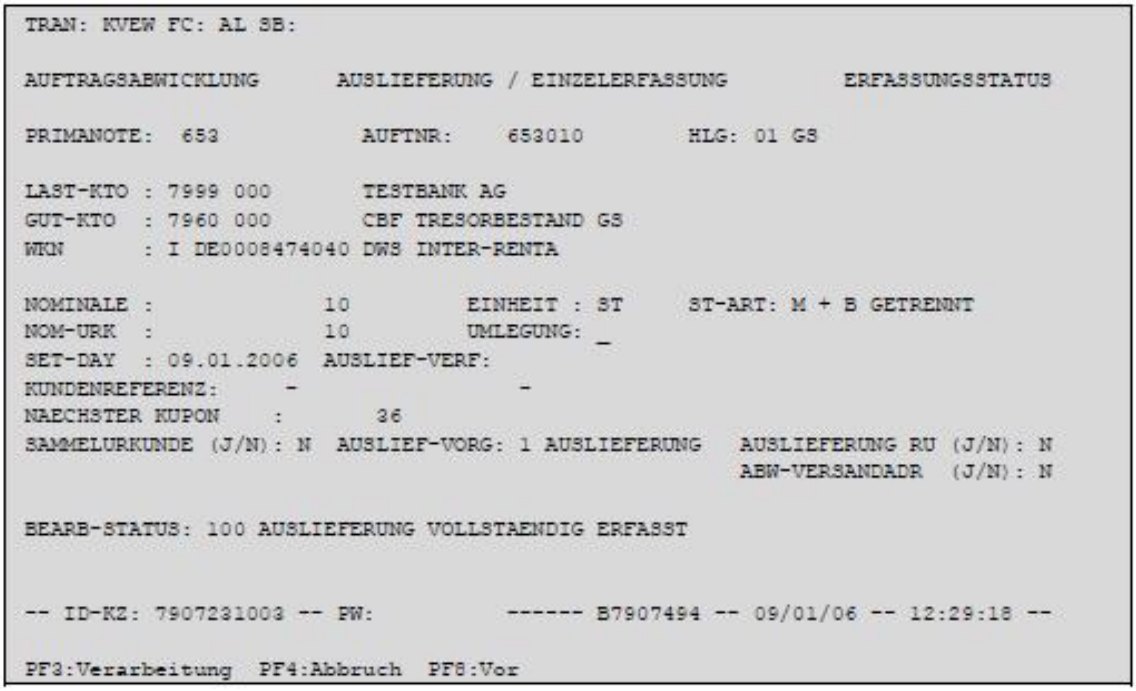
Nach Eingabe des Funktionscodes "AL" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt.


TRAN: KVEW FC: SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG E R F A S S U N G WERTEBEREICH BANK ERFASSUNGSSTATUS
CBF-TRESOR
KUNDENTRESOR BEI CBF
EL LAUFENDE EINLIEFERUNG VON EINZEL- UND TECHN. SAMMELURKUNDEN
EF EINLIEFERUNG FREMDTRESOR
NV NEUZULASSUNG / VALUTIERUNG GLOBALURKUNDEN / RAHMENURKUNDEN
AL AUSLIEFERUNG
AF AUSLIEFERUNG FREMDTRESOR
-- ID-KZ: 7907231003 -- PW: ------ B7907494 -- 09/01/06 -- 12:26:01 --
EA0395F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

(A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Auslieferungsauftrag bei der CBF buchen zu können.

(B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten



```
TRAN: KVEW FC: AL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      AUSLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG        ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:  653          AUFTNR:    653010       HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7999 000      TESTBANK AG
GUT-KTO  : 7960 000      CBF TRESORBESTAND GS
WKN      : I DE0008474040 DWS INTER-RENTA

NOMINALE :            10         EINHEIT : ST     ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :            10         UMLEGUNG: _
SET-DAY  : 09.01.2006  AUSLIEF-VERF:
KUNDENREFERENZ:     -                 -
NAECHSTER KUPON     :       36
SAMMELURKUNDE (J/N): N  AUSLIEF-VORG: 1 AUSLIEFERUNG   AUSLIEFERUNG RU (J/N): N
                                                       ABW-VERSANDADR  (J/N): N

BEARB-STATUS: 100 AUSLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST


-- ID-KZ: 7907231003 -- PW:          ------ B7907494 -- 09/01/06 -- 12:29:18 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Auslieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d.h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:	Beschreibung
AUFTNR		
HLG	"01" (GS)	Girosammelverwahrung
GUT-KTO	interner Kontonummer der CBF	Tresorkontonummer
LAST-KTO	Bank-Nr. des erfassenden Institutes	
WKN-KENNUNG	"I"	ISIN
WKN		
NOMINALE		Buchungsnominale
NOM-URK		Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung
KUNDENREFERENZ GITDRITTBANK		
SET-DAY	TTMMJHJJ	Nächstmögliche Buchungsvaluta
UMLEGUNG		
SAMMELURKUNDE	"N"	Einzelurkunden
AUSLIEF-VORG	"1"	Auslieferung Urkunde
AUSLIEFERUNG RU	"N"	Keine Rahmenurkunde
ABW. VERSANDADR	"N"	Keine abweichende Versandadresse gewünscht

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für eine laufende Auslieferung folgende Feldbesonderheiten.

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d.h. vom Kunden/Eingeber darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den CBF internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

AUSLIEF-VORG

Dieses Feld ist stets mit dem Wert "1" (Auslieferung) vorbelegt. Die Ausprägung bedeutet, dass eine effektive Auslieferung von Urkunden erfolgen soll. Bei Revalutierungsaufträgen ist das Feld "AUSLIEF-VORG:" mit dem Wert "2" zu füllen. Bei einem Revalutierungsauftrag muss grundsätzlich das Feld "SAMMELURKUNDE (J/N)" auf "J" geändert werden. Zusätzlich kann auch die Auslieferung einer Rahmenurkunde erfolgen, indem das Feld "AUSLIEFERUNG RU (J/N)" mit "J" belegt wird.

Bei Teilreduzierungsaufträgen muss das Feld "AUSLIEF-VORG:" mit dem Wert "3" gefüllt werden. Das Feld "AUSLIEFERUNG RU" muss mit "N" gefüllt sein.

GUT-KTO/LAST-KTO-/HLG

Handelt es sich beim Last-Konto um ein Kundenkonto aus dem Bereich Vorratslager für Fonds, so muss das Gut-Konto diesem entsprechen und als Hinterlegungsart ist nur (GS-) Vorratslager Bank möglich.

LAST/GUT-KTO

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

Entspricht das Last-Konto einem Kundenkonto Spezialabwicklung, dann muss es sich beim Gut-Konto ebenfalls um ein Tresorkonto Spezialabwicklung handeln.

LAST-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen. Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen (ausgenommen, wenn es sich bei dem Gut-Konto um die Konto-Art zum "Einrichten von Teilbeständen nur Kundenbestand" handelt).

NOMINALE/NOM-URK

Wird das Feld Nominale-Urkunde gefüllt, wird systemseitig das Feld Nominale ermittelt und gefüllt. Werden beide Felder gefüllt, wird systemseitig die Inhalte geprüft.

UMLEGUNG/WKN/LAST-KTO

Handelt es sich bei dem eingegebenen LAST-KTO um einen Depotbestand in Fonds im Vorratslager so können die Umlegungsgründe

- 1 Vorratslager in GS
- 2 GS in Vorratslager

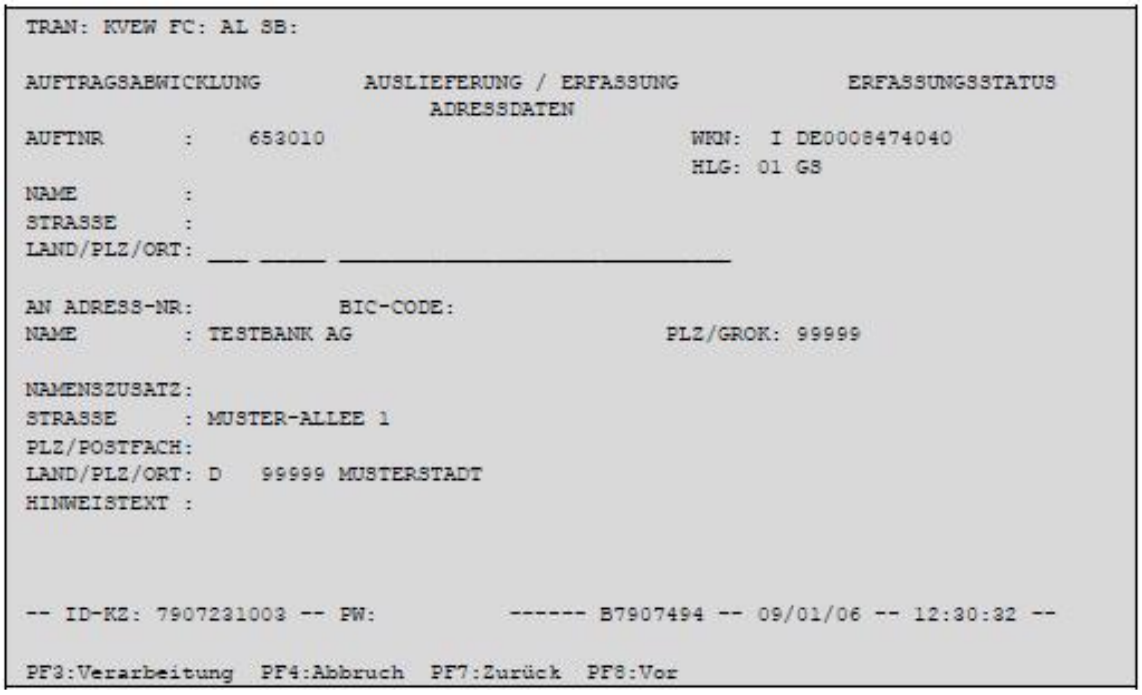
angegeben werden. Es wird automatisch die Einbuchung der entsprechenden Eingangsbuchungen vorgenommen.

12.3.4 Folgedaten Versand

(A) Allgemeine Beschreibung

Soll ein Versand an eine Dritte Bank (Vereinbarung mit CBF erforderlich) kann auf der Basismaske bei "Abw. Versandadresse" "J" = Ja eingegeben werden.

(B) Folgemaske Versandadressdaten



(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der Adressfolgedaten gelten folgende Muss-Eingaben:

Feld	vorbelegt mit:
NAME	
ORT	
Optional:	Ist die interne Adress-Nummer der CBF dem Eingeber bekannt, kann diese verwendet werden. Die Eingabe des BIC-Code ist ebenfalls möglich.

12.3.5 Stückenummern und Stückelung Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Je nach Unterauftragsart erscheint als eine dritte Eingabemaske entweder die Stückelungswunschmaske oder die Urkundenwunschmaske:

Vorgang	Maske
Auslieferung von Einzelurkunden (AUSL.-VORG 1)	Stückelungswunschmaske
Auslieferung einer Globalurkunde (AUSL.-VORG 1)	Urkundenwunschmaske
Auslieferung einer Rahmenurkunde (AUSL.-VORG 2)	Stückelungswunschmaske
Revalutierung mit Auslieferung der Rahmenurkunde (AUSL.-VORG 2)	Stückelungswunschmaske
Revalutierung ohne Auslieferung der Rahmenurkunde (AUSL.-VORG 2)	Stückelungswunschmaske
Teilreduzierung (AUSL.-VORG 3)	Stückelungswunschmaske

Achtung:

Für die Auslieferung von Bezugsrechten ist die Eingabe von Stückelungswünschen explizit ausgeschlossen.

(B) Folgemaske: Stückelungswunsch

```
TRAN: KVEW FC: AL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        AUSLIEFERUNG / ERFASSUNG            ERFASSUNGSSTATUS
                             STUECKELUNGSWUNSCH
AUFTNR:    653010                                  WKN:  I DE0008474040
                                                   HLG: 01 GS
ORD-NR:          / SAMMEL-NR:                      GES-NOM:              10
                                                   SUM-NOM:

ANZ-URKUNDEN  LIT         STUECKELUNG  ANZ-URKUNDEN  LIT         STUECKELUNG




TEXT:



-- ID-KZ: 7907231003 -- PW:          ------ B7907494 -- 09/01/06 -- 12:32:12 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

In diese Folgemaske kann der Kunde der CBF vorgeben, in welcher Stückelung die Auslieferung bedient werden soll. Sämtliche Eingaben der Bank auf dieser Maske sind KANN-Eingaben und werden als Wunschvorgabe für die spätere Stückezuweisung aus CARAD interpretiert.

- Einzelurkunden

Mögliche Eingaben zu Einzelurkunden:

LIT (Litera) ist bei Einzelurkunden ein Eingabefeld wird bei Eingabe einer Stückelung zur WKN/ ISIN geprüft

ANZ-URKUNDEN*STUECKELUNG (Eingabe von max. 10 Stückelungsangaben möglich).

Es wird systemseitig geprüft, ob diese Angaben nicht den Nominalbetrag des Auftrages übersteigen. Gleichzeitig werden die in CARAD hinterlegten Stückelungen gegen die gewünschten Stückelungen direkt geprüft.

Im freien Text kann der Erfasser Informationen für den Stückedisponenten eingeben.

- Sammelurkunden

Mögliche Eingaben zu Sammelurkunden:

LIT (Litera) ist bei Sammelurkunden ein reines Anzeigefeld und wird bei Eingabe einer Stückelung mit "*" vorbelegt. Dies bedeutet, dass die Zuweisung von Stückenummern mit oder ohne Litera ausschließlich nach dem LIFO-Prinzip erfolgt.

Für die restlichen Maskenfelder gibt es keine Änderungen bzgl. der Eingabemöglichkeiten. Sämtliche Eingaben der Bank auf dieser Maske sind KANN-Eingaben und werden als Wunschvorgabe für die spätere Zuweisung interpretiert.

So kann der Kunde

- eine bestimmte Ordnungs-Nummer/Sammel-Nummer eingeben, wenn sich die Revalutierung auf genau diese Rahmenurkunde beziehen soll

und zusätzlich

- eine Kombination von Anzahl Stückenummern pro Stückelung (max. 10) angeben

und/oder

- Informationen für den Stückedisponenten im freien Text eingeben.

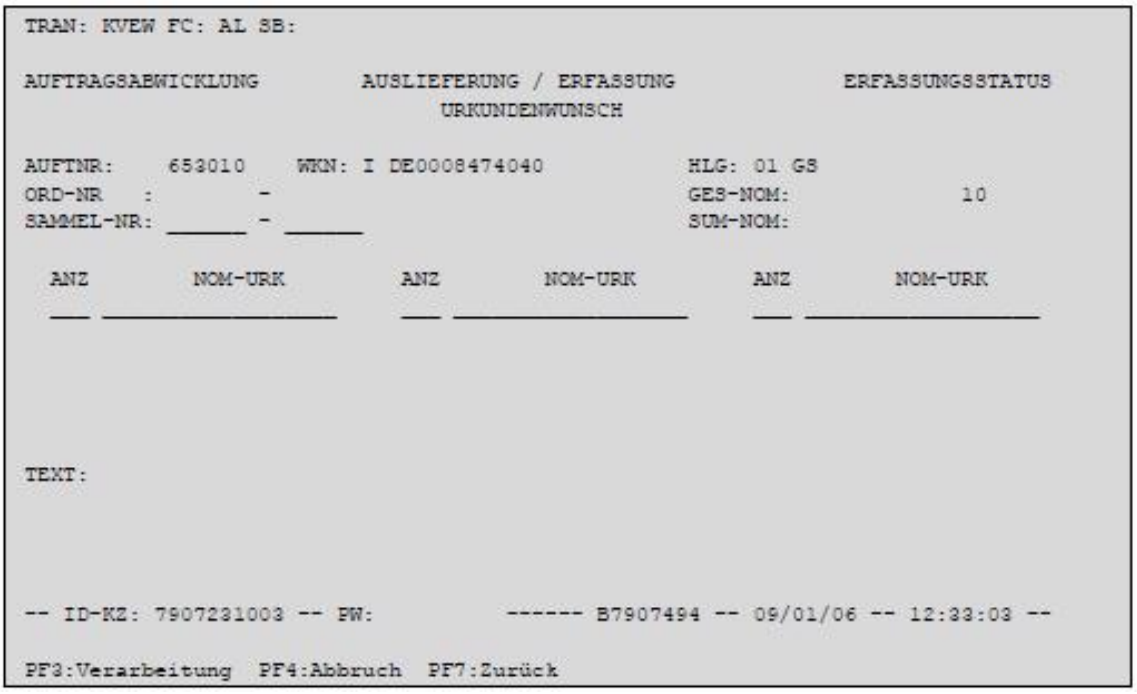
Ohne Eingabe einer Ordnungs-/Sammelnummer wird geprüft, ob die Summe aus dem valutierten Bestand aller in CARAD zur Gattung hinterlegten Rahmenurkunden größer oder gleich der Auftragsnominale (Nominale-Urkunde) ist.

Bei Eingabe einer Ordnungs-/Sammel-Nummer wird geprüft, ob in CARAD eine Rahmenurkunde mit genau dieser Ordnungs-/Sammel-Nummer vorhanden ist und ob deren valutierter Bestand größer oder gleich der Nominale-Urkunde des Auftrags ist.

Mit diesen Prüfungen wird zumindest für den Zeitpunkt der Auftragserfassung sichergestellt, dass für diesen Revalutierungsauftrag ausreichend valutierter Bestand vorhanden ist. Eingaben in der Stückelungswunschtabelle sind nur zulässig, wenn auch eine Ordnungs-/Sammelnummer angegeben wurde. Zusätzlich wird geprüft, dass die Addition der sich ergebenden Teilbeträge aus Anzahl Urkunden * Stückelung die Nominale-Urkunde des Auftrags ergibt. Ein Abgleich gegen die im CARAD-Bestand tatsächlich hinterlegten Stückelungen der Rahmenurkunde findet dabei nicht statt.

Sind die getätigten Eingaben auf allen Masken plausibel kann der Auftrag mit Betätigung der PF3-Taste abgespeichert werden.

(C) Folgemaske: Urkundenwunsch



Sofern es dem Eingeber nicht wichtig ist, über welche Urkunden die Auslieferung physisch dargestellt wird, kann er diese Maske ohne Eingaben übergehen.

Anderenfalls werden seine Eingaben als Wunschvorgabe bei der späteren Urkunden Zuweisung berücksichtigt.

Dabei gibt es für den Erfasser folgende Eingabemöglichkeiten:

- Eingabe einer einzelnen Ordnungs- oder Sammelnummer, wenn genau eine eindeutig zu identifizierende Sammelurkunde ausgeliefert werden soll.

oder alternativ

- Eingabe eines Intervalls (Von-Bis) für Ordnungs- oder Sammelnummern, wenn bei der automatischen Zuweisung nur die innerhalb dieser Begrenzung (einschließlich Anfangs- und Endnummer) hinterlegten Sammelurkunden berücksichtigt werden sollen.

oder alternativ

- Eingabe von 1 bis zu 15 unterschiedlichen Urkunden-Nominalen und der Anzahl an Sammelurkunden, die mit der jeweiligen Nominale ausgeliefert werden sollen.

und/oder

- Eingabe von Zusatzinformationen für die Stückedisposition (z.B. Stückenummernkreise) im freien Text.
- Ohne Eingaben zu Ordnungs-/Sammelnummer, Intervall oder Nominalen wird lediglich geprüft, ob die Auftragsnominale mit den in der Hinterlegungsart im Bestand befindlichen Globalurkunden darstellbar ist. D.h. die Summe der Nominale-Sammel aller berücksichtigten Globalurkunden muss gleich oder größer der Auftragsnominale sein.
- Bei Eingabe einer Ordnungs-/Sammelnummer wird geprüft, ob eine Globalurkunde mit dieser Ordnungs-/Sammelnummer in CARAD vorhanden ist. Hinterlegungsart und Wert (Nominale-Sammel) der Urkunde müssen mit den Daten des Auftrages (HLG, Nom-URK) übereinstimmen.
- Bei Eingabe eines Intervalls zu Ordnungs-/Sammelnummern wird überprüft, ob die Summe der Nominale-Sammel aller in CARAD in der Hinterlegungsart vorhandenen und innerhalb des

Intervalls liegenden Globalurkunden gleich oder größer als die Nominale-Urkunde des Auftrages ist.

- Bei Eingaben in der Nominalentabelle wird zunächst geprüft, dass die Summierung der Vorgaben aus den Feldern ANZ * NOM-URK mit der Nominale-Urkunde des Auftrags übereinstimmt. Als Zusatzinformation wird dabei während des Erfassungsvorganges die aus den Vorgaben aktuelle ermittelte Summe im Feld SUM-NOM angezeigt.
- Sind die Vorgaben plausibel, wird pro Nominalangabe überprüft, ob in CARAD mindestens die gewünschte Anzahl an Globalurkunden mit der entsprechenden Nominale in der Hinterlegungsart vorhanden ist.
- Mit der Plausibilisierung gegen CARAD wird nur sichergestellt, dass ausreichend physischer Bestand zur Bedienung des Auslieferungsauftrages vorhanden ist. Eine Prüfung auf Lieferbarkeit der Urkunden wird an dieser Stelle jedoch noch nicht durchgeführt.

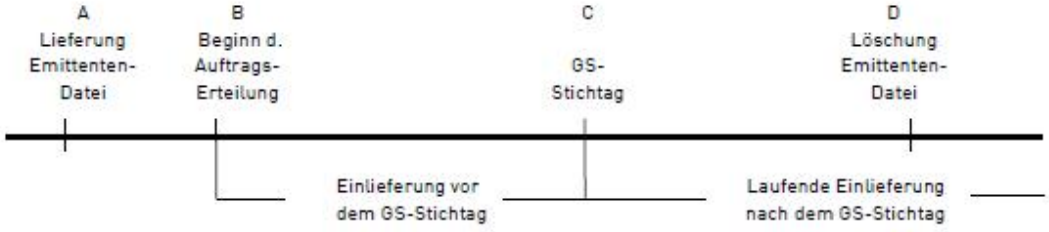
Sofern alle Auftragsdaten gültig erfasst worden sind, kann der Auftrag mit PF3 abgespeichert werden.

Leerseite

13 Namensaktien (RS)

13.1 Allgemeines

13.1.1 Phasenkonzept



Folgende Zeitintervalle gelten bei Einlieferungen von Namensaktien pro Gattung:

- Phase 1: Tag des Eintrags in das elektronische Aktienregister bis Beginn Auftragserteilung für Ersteinlieferungen
- Phase 2: Beginn Auftragserteilung von Ersteinlieferungen bis GS-Stichtag
- Phase 3: GS-Stichtag bis Löschung Emittentendatei
- Phase 4: Ab Löschung Emittentendatei (wird zurzeit nicht genutzt)

13.1.2 Settlement-Art

Einlieferungsaufträge haben als Settlement-Art immer die Vorbelegung RTS. Entsprechend dem Freigabezeitpunkt des Auftrages wird der Auftrag in RTS oder in der STD-Verarbeitung gebucht.

13.1.3 Auftragserteilung per Datenfernübertragung (DFÜ)

Auftragserteilungen für Einlieferungen (Neuzulassung/Valutierungen und lfd. Einlieferungen) können sowohl online als auch per DFÜ erteilt werden. Per DFÜ erteilte Aufträge erhalten ein entsprechendes Kennzeichen.

Wird ein DFÜ Auftrag von der CBF-Prüfstelle zurückgeneriert, erhält der Kunde keine automatische Meldung darüber. Der Auftrag wird auf einer Liste ausgegeben und der Kunde ist manuell zu informieren.

13.1.4 Auseinanderfallen von technischem und fachlichem GS-Stichtag

Der fachliche GS-Stichtag ist der Tag, zu dem die Gattung tatsächlich aufgenommen wird. Damit die notwendigen Buchungen im Vorfeld korrekt ausgeführt werden, wird als GS-Stichtag der sog. technische GS-Stichtag verschlüsselt, der sich als "fachlicher GS-Stichtag minus eine Woche" berechnet.

Zur Erläuterung sei hier der Ablauf bei der Neuzulassung einer Globalurkunde dargestellt.

Zum fachlichen GS-Stichtag wird FMB benötigt. Spätestens eine Woche vor dem fachlichen GS-Stichtag wird in WSS das Feld "Verwahrmöglichkeit neu ab" der technische GS-Stichtag über WM eingepflegt. Der Leadmanager erhält von CBF den Fahrplan zur Umstellung und gibt u. a. diese Info an WM weiter.

Am fachlichen GS-Stichtag minus drei Tage wird die Urkunde gebucht; dadurch entsteht FMB KE. Am selben Tag wird die Ersteintragung des gesamten Bestandes auf den Namen des Treuhänders

veranlasst. CBF erfasst den Auftrag in KVCE/EE. Die Information geht dann ans Aktienregister. Dadurch entsteht FMB KE.

Am fachlichen GS-Stichtag minus zwei Tage kommt die Rückmeldung vom Aktienregister, dass der Treuhänder eingetragen wurde; dadurch entsteht Hauptbestand. CBF nimmt einen Bestandsübertrag vor. Dadurch entsteht FMB, und dieser Aktionär wird zur Austragung vorgemerkt.

Am GS-Stichtag minus ein Tag wird von CBF der Übertrag des gesamten Bestandes an den Leadmanager vorgenommen (von Abwicklungskonto an Leadmanager in FMB).

13.1.5 Allgemeines zum KE-Typ

Der KE-Typ beinhaltet die Informationen „WKN des Rechts“, “Ex-Tag” und “Art der Kapitalerhöhung”. Er wird bei Bestandsschaffung angelegt. Das bei Valutierung ergänzte ”Datum KE” gehört zur Stückenummer, gibt das Ausübungsdatum zur Stückenummer wieder. Bei Bestandsschaffung wird die Stückenummer angelegt.

Es ist nicht möglich, zu einem existierenden KE-Typen einen zweiten KE-Typ mit derselben WKN und demselben Ex-Tag, aber unterschiedlicher Art der Kapitalerhöhung anzulegen. Dies ist allerdings kein Problem der Einlieferung. Es einlieferungsseitig zuzulassen, löst das Problem nicht. Die Plausibilitätsprüfung bei der Einlieferung verhindert lediglich, dass der Ablauf später in RS abbricht.

13.1.6 Allgemeines zur Weiterleitung KE-Typ an Aktienregister

Weitergeleitet werden folgende Daten:

- Nominale
- Stückenummer und Stückelung
- WKN des Rechts
- Ex-Tag
- Datum KE (bei bedingter Kapitalerhöhung)
- Art der Kapitalerhöhung

13.1.7 Kundenanforderungen hinsichtlich der einzureichenden Urkunde

Es sollte möglichst eine Rahmenurkunde eingereicht werden. Sollte hingegen eine permanente Urkunde bei Kapitalerhöhung gegen Einlagen eingereicht werden, dann ist deren Höhe fix und unveränderbar. Ein- und Auslieferungen sind nicht gewünscht, nicht vorgesehen und auch nicht möglich.

Die RS-Gattungen sind alle immer mit Verwahrmöglichkeit 016 (GS-Verwahrung, technische Globalurkunde) verschlüsselt. Nach den derzeitigen Plausibilitäten sollten solche Gattungen zwar nur als Rahmenurkunden hinterlegt werden. Es können jedoch feste Globalurkunden wie auch bis-zu-Globalurkunden verwendet werden.

Prinzipiell sind Globalurkunden wertpapier**rechtlich** immer Sammelurkunden im Sinne des § 9a DepotG, unabhängig davon, ob es sich wertpapier**technisch** um Festbetrags- oder „Bis-zu"-Globalurkunden handelt. Es können mehrere Sammelurkunden existieren, die den GS-Gesamtbestand in einer Gattung verbriefen.

Existieren in einer Gattung mehrere effektentechnisch unterschiedliche Globalurkunden, so ist rechtlich lediglich darauf zu achten, dass durch die Urkunden insgesamt nicht mehr bzw. nicht weniger als das Grundkapital der Gesellschaft (bei Aktien) bzw. der Gesamtwert der Emissionen (bei anderen Wertpapierarten) repräsentiert werden.

Rechtlich macht es keinen Unterschied, welche Art von Globalurkunden in CASCADE-RS aufgenommen bzw. geführt wird, sofern sichergestellt ist, dass diese den GS-Gesamtbestand insgesamt korrekt abbilden.

Der Emittent ist regelmäßig frei in seiner Entscheidung, welche Form von Globalurkunden er einreicht. CBF empfiehlt den Kunden die Einreichung von „Bis-zu"-Urkunden, weil dann die Kunden flexibler sind. Wenn jedoch der Kunde auf der Einreichung einer Festbetragsurkunde besteht, kommt CBF diesem Wunsch nach, wenn es fachlich korrekt ist (z. B. kann bei flexibler Höhe des Kapitals keine Festbetragsurkunde hinterlegt werden).

13.2 Aufträge zur lfd. Einlieferung von Namensaktien (RS)

13.2.1 Allgemeines

Die Zulassung zur Girosammelverwahrung von (vinkulierten) Namensaktien (RS) kann mit der Einlieferung der effektiven Einzelurkunden inkl. Eintragungsbestätigung und Abtretungserklärung zum Umtausch und Depotgutschrift in Miteigentumsanteile an einer Globalurkunde erfolgen.

13.2.1.1 Rahmenvertrag

Für laufende Einlieferungen von Namensaktien können Banken mit CBF einen Rahmenvertrag abschließen. In einem solchen Vertrag wird vereinbart, dass die Depotbank von den Aktionären die original Aktienurkunden entgegennehmen kann. Diese sind durch die Bank auf Echtheit, Lieferbarkeit und Opposition zu prüfen. Die einliefernde Bank erhält im Gegenzug zur elektronischen Einlieferung am GS-Stichtag sowie nach jeder weiteren elektronischen Einlieferung von Aktienurkunden ab dem GS-Stichtag ein Stückenummern-Verzeichnis.

Dies dient als rechtsverbindlicher Nachweis über die aus dem Umtausch hervorgegangenen Miteigentumsanteile der effektiven Aktienurkunden an der „Bis-zu Globalurkunde", die bei CBF verwahrt wird. Der Kunde verpflichtet sich, die den eingelieferten Namensaktien entsprechenden effektiven Aktienurkunden, Eintragungsbestätigungen sowie Abtretungserklärungen nach Erhalt des Stückenummern-Verzeichnisses zur Vermeidung von Doppelverbriefungen unverzüglich zu entwerten oder durch geeignete Maßnahmen vor unbefugtem Zugriff zu sichern. Dem Kunden bleibt das Recht vorbehalten, die in dem Stückenummern-Verzeichnis anhand der Stückenummern bezeichneten effektiven Aktienurkunden sowie die Abtretungserklärungen und die Eintragungsbestätigungen zu vernichten. Macht der Kunde von diesem Recht Gebrauch, soll die Vernichtung frühestens 12 Monate nach dem jeweiligen Valutierungstag der Globalurkunde erfolgen.

In KUSTA wird je Depotbank die Information hinterlegt, dass ein solcher Rahmenvertrag abgeschlossen wurde.

Bei der Erfassung eines laufenden Einlieferungsauftrages wird systemseitig die Information mit/ohne Urkunden entsprechend der Information in KUSTA vorbelegt.

Das heißt:

- Banken haben einen Rahmenvertrag abgeschlossen:
  - Sendet die Bank die Aktienurkunden nicht an CBF, somit wird im Auftrag "ohne Urkunden" vorbelegt.
  - Möchte die Bank trotz Rahmenvertrag die Aktienurkunden an CBF senden, so kann sie dies tun. Im Auftrag ist dann die Angabe "mit eff. Urk.u.Zession" zu machen.
  - Banken, die keinen Rahmenvertrag abgeschlossen haben, senden die Aktienurkunden an CBF, somit wird im Auftrag "mit Urkunden" vorbelegt.

13.2.1.2 Bestands-Art

Bei der Einlieferung muss sich der Einlieferungsauftrag auf den eingetragenen Aktionär beziehen. Sollte für die streifbandverwahrten Aktienurkunden der aktuelle Aktionär noch nicht in das Aktienregister eingetragen worden sein, so muss sich der Auftrag auf den derzeit eingetragenen Aktionär beziehen.

Die Bank muss bei der Erfassung des Einlieferungsauftrages ein Kennzeichen Bestand (KZ-BST) mitliefern. Ist der aktuelle Aktionär bereits im Register eingetragen, liefert sie das Kennzeichen "HB (Hauptbestand)". Ist der aktuelle Aktionär noch nicht im Register eingetragen, liefert die Bank das Kennzeichen "FM (Freier Meldebestand)".

Das Bestandskennzeichen gibt somit vor, welche Bestandsart bei der Verbuchung des Einlieferungsauftrages in CASCADE-RS geschaffen wird. Die Prüfungen der Daten des

Einlieferungsauftrages gegen die Emittentendatei erfolgen auf die Daten des noch eingetragenen Aktionärs.

13.2.1.3 Voraussetzungen für laufende Einlieferungen

Für alle laufenden Einlieferungen (incl. BoNY-Link) ist die Voraussetzung, dass eine Rahmenurkunde mit dem Einlieferungsgrund 4 angelegt ist. Bei der Überleitung der Daten der laufenden Einlieferungen nach CARAD werden nur Rahmenurkunden mit Einlieferungsgrund 4 (oder 5) hochgeschrieben. Sind mehr als eine Rahmenurkunde mit Einlieferungsgrund 4 (oder 5) in dieser Gattung vorhanden, so wird zuerst die Urkunde mit der kleinsten Sammelnummer herangezogen.

13.2.1.4 Ersteinlieferung

Unter Ersteinlieferung versteht man laufende Einlieferungen, die vor GS-Stichtag erfasst werden. Sie werden dann am Bankarbeitstag vor GS-Stichtag verarbeitet per GS-Stichtag.

- Bank erfasst in CASCADE Einlieferungsauftrag (KVEW/EL), mit HLG: 99 FUER GS VORGESEHEN. Der Buchungstag im Auftrag wird automatisch mit dem GS-Stichtag vorbelegt.
- Prüfung der Einlieferungsaufträge bei Erfassung: gegen Oppositionsliste und auf doppelte Stückenummern gegen CARAD. Die Stückelung muss in WSS vorhanden sein. Sind die Stückenummern des Einlieferungsauftrages bereits im CARAD-Bestand oder Auftragsbestand (offene Einlieferungsaufträge) vorhanden, wird der Auftrag abgelehnt.
- Die Plausibilisierung gegen die Emittentendatei prüft die Aktionärsnummer und die Stückenummern/Stückelung in Kombination. Dies geschieht vor GS-Stichtag einmal täglich im Batch. Über die Eingabe der Kundenreferenz wird batch (nicht online) ein WP-Besitzer angelegt.
- Wenn der Auftrag erfolgreich alle Prüfungen "besteht", gelangt der kontrollierte Auftrag in den Auftragsstatus. Sollte eine der Prüfungen negativ ausfallen, so wird der Auftrag vom System abgelehnt und eine Weiterverarbeitung ist nicht möglich. Der Auftrag bleibt im Auftragsstatus und es wird eine Fehlerliste erstellt. Diese geht an den Tresor/Clearstream und an den Kunden.Aufträge werden bis zum Erreichen des Datums "Buchungstag" (GS-Stichtag) vorgetragen.
- Laufende Einlieferungen für RS-Gattungen haben einen eigenen Eingangsbuchnummernkreis (größer 8.000.000). Mit Vergabe der Eingangsbuchnummer liegt die Verantwortung der weiteren Bearbeitung des Auftrages bei der CBF.
- Nach der Überleitung zur Dispo inkl. weiterer Plausibilitätsprüfungen und ggf. Anlegen einer Kundenreferenz in RTS/STD erfolgt die Buchung und Weiterleitung Verwahrartänderung an AR. Dann wird der Nummernbuchbeleg für die Banken erstellt.

13.2.1.5 Verarbeitung der Ersteinlieferungen am GS-Stichtag -1 BA per GS-Stichtag

- Einlieferungsaufträge wurden bereits vor GS-Stichtag erfasst und geprüft.
- Es erfolgt eine Plausibilisierung gegen WSS-Daten (z. B. kleinste übertragbare Einheit und gültiger Coupon), KUSTA und Emissionsüberwachung.
- a) Nach erfolgreicher Prüfung der Daten erfolgt in der STD-Verarbeitung per GS-Stichtag die Buchung der Einlieferungsaufträge.
- b) Bei aufgetretenen Prüfungsfehlern werden die Einlieferungsaufträge in die nächstmögliche Verarbeitung am GS-Stichtag vorgetragen. Diese ist eine RTS-Verarbeitung. Die ordnungsgemäße, vollständige automatische Verarbeitung des Vorgangs wird nur in der STD Verarbeitung durchgeführt. Erfolgt eine Buchung der Aufträge in einer nicht STD-Verarbeitung, so ist die Erzeugung und der Versand des Nummernbuchbeleges (siehe 6.) manuell über die IT (und RZ-Steuerung) vor der Überleitung an CARAD (vor RTS und STD) anzustoßen.
- Laufende Einlieferungen mit dem Kennzeichen "ohne Urkunden" erhalten systemseitig den Status vereinnahmt. Aufgrund der Buchung des Einlieferungsauftrages erfolgt über CASCADE-RS die Weiterleitung der Daten der Einlieferungen als Verwahrartänderungen an das Aktienregister. Die Weiterleitung an die Emittenten findet einmal täglich um ca. 18:30 Uhr statt.

Bei der Versendung werden alle Dateien herangezogen, die jeweils im Feedback der einzelnen Dispositionsläufe erstellt worden sind. Besonderheit: An GS-Stichtagen kann auf Vereinbarung mit dem Aktienregister ein Sonderversender gestartet werden, da ansonsten die Verwahrartänderung erst am Folgetag an das Aktienregister versendet würde und beim Emittenten keine Wochenendverarbeitung stattfinden könnte.

- Es wird pro Bank ein Nummernbuchbeleg erzeugt und an die Banken versandt. Für alle Aufträge mit Rahmenvertrag wird automatisch ein Nummernbuchbeleg erstellt (in CASCADE E/A). Es werden alle Einlieferungen mit Stückenummern aufgelistet.
- Gleichzeitig werden diese Informationen als Microfiche zur CBF-internen Historisierung erzeugt. Die Aufbewahrungsfrist beträgt sechs Jahre.
- Die Stückenummern werden am nächsten Buchungstag automatisch in STD nach CARAD übergeleitet, und die Rahmenurkunde mit EG4 wird entsprechend hochgeschrieben.
- Durch die Aktienregister (auf Steuerung des Emittenten) erfolgt die Aktualisierung der Emittentendatei und die Lieferung der aktuellen Emittentendatei per File Transfer an CBF und wird täglich einmal eingespielt.
- Bei der Einlieferung am GS-Stichtag erhält der Auftrag bei Verarbeitung vor RTS-Ende eine Valutierung per GS-Stichtag.

13.2.1.6 Verarbeitung der am GS-Stichtag minus 1 BA erfassten Ersteinlieferungen

Am Tag vor dem GS-Stichtag (also typischerweise der Freitag) eingegebene Aufträge werden durch den in Ersteinlieferung auf Seite 13-5 beschriebenen Ablauf (insbesondere die Prüfung auf die Emittentendatei) nicht mehr vor dem STD-Buchungslauf validiert. Somit erfolgt die Verbuchung dieser Aufträge erst in den folgenden Dispo-Läufen (RTS oder STD) am GS-Stichtag selbst.

13.2.1.7 Laufende Einlieferung (nach GS-Stichtag):

Die laufende Einlieferung bezieht sich je nach Vorgabe Bestandskennzeichen auf FMB oder HB.

- Bank erfasst in CASCADE Einlieferungsauftrag (KVEW/EL), mit HLG "01 GS".
- Prüfung der Einlieferungsaufträge bei Erfassung: gegen Oppositionsliste und auf doppelte Stückenummern gegen CARAD. Sind die Stückenummern des Einlieferungsauftrages bereits im CARAD-Bestand oder CARAD-Auftragsbestand (offene Aufträge) vorhanden, wird der Auftrag abgelehnt. Die Plausibilisierung gegen die Emittentendatei, die die in STR geführten Stücke enthält, prüft die Aktionärsnummer und die Stückenummern/Stückelung in Kombination. Täglich abends erfolgt erneut eine Prüfung gegen die neuen Meldungen der Oppositionsliste.
- Bei der Erfassung des Einlieferungsauftrages und bei der Überleitung erfolgt eine Plausibilisierung gegen WSS-Daten (z. B. kleinste Übertragbare Einheit und gültiger Coupon). Abgelehnte Aufträge erscheinen in der CASCADE-Fehlerliste.
- Banken erhalten gegebenenfalls ein entsprechendes Fehlerprotokoll aus der abendlichen Prüfung gegen die Oppositionsliste.
- Im Auftrag ist immer die SET-ART RTS vorbelegt. Der Auftrag wird entsprechend des Freigabezeitpunktes in CASCADE in RTS oder STD gebucht.
- Aufgrund der Buchung des Einlieferungsauftrages erfolgt über CASCADE-RS die Weiterleitung der Daten der Einlieferungen als Verwahrartänderungen per File Transfer an das Aktienregister.
- Die Weiterleitung an die Emittenten findet einmal täglich um ca. 18:30 Uhr statt. Bei der Versendung werden alle Dateien herangezogen, die jeweils im Feedback der einzelnen Dispositionsläufe erstellt worden sind.
- Es wird täglich pro Bank ein Nummernbuchbeleg erzeugt und an die Banken versandt. Gleichzeitig werden diese Informationen als Microfiche zur CBF-internen Historisierung erzeugt.
- Die Stückenummern werden am nächsten Buchungstag automatisch in STD nach CARAD übergeleitet und die Rahmenurkunde wird entsprechend hochgeschrieben.

Durch die Aktienregister erfolgt die Aktualisierung der Emittentendatei und die Lieferung der aktuellen Emittentendatei per File Transfer an CBF. Die Lieferung erfolgt je Register zu individuellen Zeitpunkten. Die Verarbeitung durch CBF ist jederzeit möglich.

13.2.1.8 Laufende Einlieferung nach GS-Stichtag: Besonderheit Überträge aus USA (BoNY-Link)

Für Gattungen, die sowohl im Ausland als auch in Deutschland gehandelt werden, wurden sogenannte Global Shares ausgestellt. Dafür sind sowohl im Ausland als auch bei CBF Rahmenurkunden über die Gesamtnominale der Emission hinterlegt. Diese werden je nach Bedarf hoch- und heruntergeschrieben. Das Herunterschreiben erfolgt über eine Auslieferung (Bestandsübertrag mit Grund 2 Entnahme). Das Hochschreiben erfolgt über eine laufende Einlieferung.

Zurzeit existieren drei Gattungen, für die dieses Verfahren angewendet wird. Diese sind DaimlerChrysler AG (ISIN DE0007100000), Deutsche Bank AG (ISIN DE0005140008) und Celanese AG (ISIN DE0005753008). Da die betroffenen Banken i. d. R. eine gleichtägige Buchung erwarten, wird hier grundsätzlich das Verfahren der manuellen Freigabe verwendet.

Technisch werden die laufenden Einlieferungen wegen BoNY-Link und die übrigen laufenden Einlieferungen gleich behandelt. Es besteht lediglich eine fachliche Unterscheidung.

13.2.1.9 Manuelle Freigabe

- Bank erfasst in CASCADE Einlieferungsauftrag (KVEW) mit Set–Art RTS vorbelegt.
- Prüfung der Einlieferungsaufträge bei Erfassung: gegen Oppositionsliste und auf doppelte Stückenummern gegen CARAD. Sind die Stückenummern des Einlieferungsauftrages bereits im CARAD-Bestand oder CARAD-Auftragsbestand (offene Aufträge) vorhanden, wird der Auftrag abgelehnt. Die Plausibilisierung gegen die Emittentendatei prüft die Aktionärsnummer und die Stückenummern/Stückelung in Kombination.
- Bank sendet Fax an ORS, damit durch diese die Freigabe erfolgt
- Nach manueller Prüfung, dass Auftrag mit Nachweisart 4 (ohne Urkunden) erfasst wurde, führt ORS die Effektenannahme, Freigabe und Zustimmung zur Buchung durch.
- Es erfolgt eine Plausibilisierung gegen WSS-Daten (z. B. kleinste übertragbare Einheit und gültiger Coupon). Banken erhalten ein entsprechendes Fehlerprotokoll.
- Der Auftrag wird in CASCADE in RTS gebucht.
- Anschließend die Punkte 6. – 9. aus laufende Einlieferung nach GS-Stichtag (Verarbeitung der am GS-Stichtag minus 1 BA erfassten Ersteinlieferungen auf Seite 13-6)

13.2.2 Auftragserfassung

Folgende Aufträge werden hier erfasst:

Einlieferungen von (vinkulierten) Namensaktien (RS) zur Einbeziehung in die Girosammelverwahrung vor dem GS-Stichtag.

Die Daten für einen zu erfassenden Einlieferungsauftrag für Namensaktien in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- weitere wertpapierrelevante Folgedaten (Folgemaske 1)
- Zessionsdaten (Folgemaske 2)
- Stückenummern (Folgemaske 3)
  - für Einzelurkunden

  oder
  - für technische Sammelurkunden

Einlieferungsgrund "4"Einlieferung ohne Urkunden (RS-Rahmenvertrag)

Die Einlieferungen können nur je Aktionär eingegeben werden. Die Erfassung des Einlieferungsauftrages ist unabhängig von der gewählten Einlieferungsmöglichkeit. Ob Urkunden effektiv an CBF mitgeliefert werden oder nicht, ist aus dem Feld Nachweisart = "4" (Einlieferung ohne Urkunden, da RS-Rahmenvertrag) zu entnehmen.

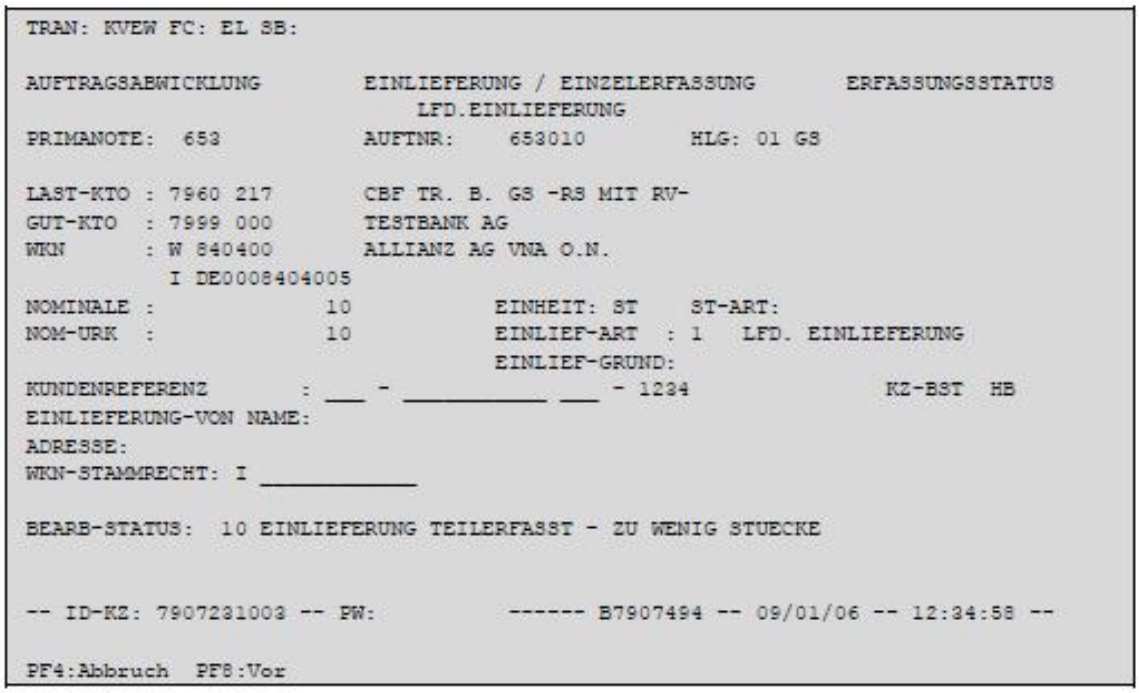
Nach Eingabe des Funktionscodes "EL" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt. Die Buchungsvaluta wird über den geplanten GS-Stichtag der betroffenen Namensaktie gesucht.

13.2.3 Buchungsrelevante Auftragsdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Einlieferungsauftrag (für RS) bei der CBF buchen zu können.

(B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten



(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:	Beschreibung
AUFTRNR		
HLG	"99" (GS – vorgesehen) Phase B	
	"01" (GS) ab Phase C	
		Girosammelverwahrung vorgesehen
EINLIEF-ART	"1" (Einlieferung)	laufende Einlieferung
LAST-KTO	interner Kontonummer	Tresorkontonummer

Feld	vorbelegt mit:	Beschreibung
GUT-KTO	Bank-Nr. des erfassenden Institutes	
WKN-KENNUNG	"I"	ISIN
WKN		
NOMINALE		Buchungsnominale
NOM-URK		Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung, sofern diese von Nominale abweicht.
KREF-KUNDE	Mussfeld, wenn KZ-BST = HB	Kundenreferenz
KZ-BST	"HB"	Hauptbestand RS

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für die Ersteinlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d.h. vom Kunden darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
GUT-KTO	Niederlassungen können nur Einlieferungen zugunsten der Zentrale tätigen. (REG-ÜBER-Bedingungen). Kunden mit Bestandsführung über eine dritte Depotbank können keine Ersteinlieferungen tätigen.
HLG	Es ist nur folgende Hinterlegungsart vor dem GS-Stichtag für die Einlieferung möglich: -> "99" GS – vorgesehen Nach dem GS-Stichtag -> "01" GS –
KZ-BST	Das Feld wird mit "HB" für "Hauptbestand" vorbelegt und kann mit "FM" für "Freier Meldebestand" überschrieben werden.
WKN	Die Namensaktie muss zur Einlieferung zugelassen sein. In einem Auftrag bzw. einer Einlieferung können nur Urkunden einer Wertpapierkennnummer zusammengefasst werden.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

GUT-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen. Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen (REG-ÜBER-BEDINGUNGEN).

HLG/WKN

Vor dem GS-Stichtag ist bei der Einlieferung von Namensaktien nur die HLG 99 = GS-vorgesehen erlaubt. Nach dem GS-Stichtag ist nur "01" Girosammelverwahrung erlaubt.

NOMINALE/NOM-URK

Werden beide Felder gefüllt, wird systemseitig die Inhalte geprüft.

WKN/KZ-BST

Das Kennzeichen-Bestand (KZ-BST) darf nur belegt sein, wenn die eingegebene WKN/ISIN als (vinkulierte) Namensaktie zu Einlieferung zugelassen ist.

KUNDENREFERENZ-KUNDE/KZ-BST

Ist das Feld KZ-BST mit der Ausprägung "HB" für Hauptbestand belegt, muss das Feld "Kundenreferenz- Kunde" gefüllt sein.

WKN/EINLIEF-GRUND

Handelt es sich beim Einlief-Grund um die Ausprägungen 1 (aus Emission), dann dürfen keine (vinkulierten) Namensaktien (RS) eingegeben werden.

13.2.4 Wertpapierrelevante Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Für die korrekte Bearbeitung und Abwicklung eines Ersteinlieferungsauftrages müssen neben den buchungsrelevanten Informationen noch weitere wertpapierspezifische Daten im Auftrag erfasst werden. Dazu wird nach der Verarbeitung der buchungsrelevanten Auftragsdaten auf eine Folgemaske verzweigt.

(B) Folgemaske wertpapierrelevanter Daten

```
TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / FOLGEERFASSUNG        ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD.EINLIEFERUNG
AUFTNR:    653010                                  WKN:  I DE0008404005
                                                   HLG:  01 GS

VERWAHR-MOEGLICHKEIT    :  16 GS,TEC.GL.URK.BIS-ZU
BESONDERHEIT            :   5 MANTEL, BOGEN, ZESSION
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG :   0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :                        LETZT. KUPON    :

UEBERF KUPON        VON :                        BIS             :

NACHWEISART:   4 OHNE URKUNDEN                   SAMMELURKUNDE   : N (J/N)



TEXT:

-- ID-KZ: 7907231003 -- PW:          ------ B7907494 -- 09/01/06 -- 12:36:26 --

PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich.

Feld	vorbelegt mit:
PRIMANOTE	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
AUFTRAGSNR	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
HLG	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
NACHWEISART	“04” = Einlieferung ohne Urkunden-Rahmenvertrag RS “05” = Einlieferung mit Urkunden RS
SAMMELURKUNDE	“N”
ABWEICHENDE BEZEICHNUNG	“0“ = kein Eintrag

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten für eine Einlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
NÄCHSTER KUPON	Die Eingabe für dieses Feld wird gegen die zum Wertpapier gespeicherten Informationen geprüft. Eine Eingabe ist nur möglich, wenn zur Gattung die Stückeart mit dem Wert 1, 3, 5, 8, 15 oder 16 belegt ist. Da RS-Gattungen normalerweise die Stückeart 0 besitzen, ist in der Regel keine Eingabe den Kupons möglich.
SAMMELURKUNDE	Wird mit "N" für 'Nein' vorbelegt. Kann mit 'J' für 'Ja' überschrieben werden.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

WKN/BESONDERHEIT

Mit dem Beginn der Auftragserteilung für die Einlieferung von Namensaktien sind nur die Stücke-Besonderheiten "05" und "06" (Mantel, Bogen, Zession für RS) möglich.

WKN/NACHWEISART

Bei Namensaktien, die für die Einlieferung zugelassen sind, sind in der Nachweisart nur die Ausprägungen "04" (Einlieferung ohne Urkunden) und "05" (Einlieferung mit Urkunden) erlaubt.

NACHWEISART/GUT-KTO

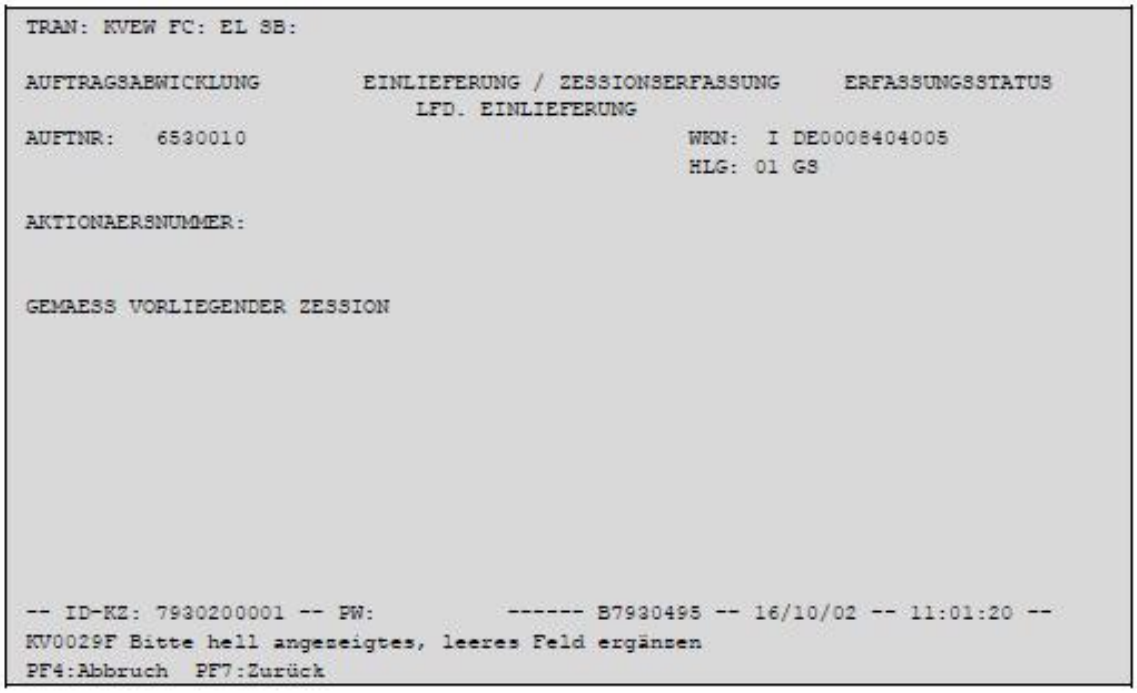
Ist die Nachweisart mit "04" (Einlieferung mit Rahmenvertrag) belegt, muss mit dem Kunden ein Rahmenvertrag abgeschlossen sein. Abweichend können alle Kunden mit der Nachweisart "05" (Einlieferung effektiver Urkunden vorgesehen) Aufträge an CBF erteilen. Das Feld kann überschrieben werden.

13.2.5 Zession Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Bei Einlieferungsaufträgen für Namensaktien müssen zusätzlich noch die Zessionsdaten angegeben werden, die arbeitstäglich gegen die aktuellen Emittentendaten abgeglichen werden.

(B) Folgemaske Zessionsdaten


TRAN: KVEW FC: EL SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG EINLIEFERUNG / ZESSIONSERFASSUNG ERFASSUNGSSTATUS
LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR: 6530010 WKN: I DE0008404005
HLG: 01 GS
AKTIONAERSNUMMER:
GEMAESS VORLIEGENDER ZESSION
-- ID-KZ: 7930200001 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:01:20 --
KV0029F Bitte hell angezeigtes, leeres Feld ergänzen
PF4:Abbruch PF7:Zurück

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der Zessionsdaten zu einer Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AKTIONÄRSNUMMER	

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (siehe Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen auf Seite 9-1) gelten bei der Erfassung von Stücke-Besonderheiten für eine Wertpapiereinlieferung folgende Feldbesonderheiten:

Feld	Beschreibung
PRIMANOTE	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
AUFTRAGSNR	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
HLG	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.

13.2.6 Stückenummern Folgedaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Zur vollständigen Auftragserteilung ist es notwendig, die zugehörigen Stückenummern der einzuliefernden Urkunden im Auftrag anzugeben. Zur Erfassung und Bearbeitung dieser Daten steht eine dritte Folgemaske zur Verfügung. Die Eingabe der Stückenummern für die Einlieferung von Namensaktien unterliegt den gleichen Erfassungsregeln und Prüfungen (Opposition und doppelte Stückenummern) wie die der lfd. Einlieferungen anderer Gattungen.

Vor dem GS-Stichtag werden ab einem bestimmten Termin die Aktionärsnummer und Stückenummern für Einlieferungen von Namensaktien täglich im Batchlauf gegen die Emittentendaten abgeglichen. Nach dem GS-Stichtag wird diese Prüfung direkt bei der Erfassung der Daten vorgenommen und zusätzlich im täglichen Batchlauf erneut diesem Abgleich unterzogen.

Tritt ein Fehler bei diesem Abgleich auf, kann der Auftrag nicht mehr weiterverarbeitet werden. In diesem Fall weist das Feld "Mangel" auf der Bildschirmseite "Stückenummern" auf diesen Sachverhalt hin. Die Fehlerbereinigung geschieht analog der Oppositionsprüfungen.

Treten gleichzeitig Oppositions- und Emittentenfehler in einem Auftrag für eine Stückenummer auf, kann der Fehlerhinweis zu den Aktionärsdaten von der Oppositionsmeldung überschrieben werden. Deshalb würde bei der Löschung des Oppositionsgrundes die Kennzeichnung wegen Emittentendatenfehler bis zum nächsten Abgleich des Gesamtbestandes gegen die Emittentendaten fehlen.

Die Klärung von Differenzen in den Aktionärsdaten muss der Kunde mit den Emittenten direkt vornehmen. Die Kunden erhalten eine Liste über die abgelehnten Aufträge (siehe Auswertungen auf Seite 23-1).

13.3 Neuzulassung/Valutierung (NV)

Bei der Neuzulassung werden immer physische Urkunden eingereicht.

13.3.1 Neuzulassung Globalurkunde (GS-Aufnahme/Umstellung Inhaber- in Namensaktien)

Fachlich geht es hier um die Neuzulassung einer Festbetragsurkunde oder einer Rahmenurkunde, die sofort in voller Höhe zu valutieren ist. Dies geschieht bei:

- GS-Aufnahme oder
- Umstellung Inhaber- in Namensaktien oder
- Kapitalerhöhung bzw. generell bei
- Kapitalmaßnahmen, die mit einer Änderung des Kapitals einhergehen.

Der Leadmanager gibt in Abstimmung mit CBF/ORS den technischen GS-Stichtag vor.

- Erfassung des Einlieferungsauftrages zur Einbuchung der Globalurkunde
  - Neuzulassung Globalurkunde (KVEW/NV)
  - Nominale Urkunde größer 0
  - Einlieferungsart 2 (Neuzulassung Globalurkunde) oder 4 (Neuzulassung valutierte
  - Rahmenurkunde)
  - Einlieferungsgrund: 2 (KE gegen Einlage) oder 7 (Gratisaktien)
  - Rahmen-Nominale gleich 0 bei Festbetragsurkunde, ungleich 0 bei Rahmenurkunde
  - Ordnungsnummer (Kannfeld bei Festbetragsurkunde, Mussfeld bei Rahmenurkunde))
  - Stückelung und Stückenummern
  - WKN des Rechts
  - Ex-Tag
- Kontrolle Einlieferungsauftrag
- Funktionen in CASCADE-RS

Der KE-Typ wird angelegt mit der WKN des Rechts und dem Ex-Tag. Mit der Buchung werden die Stückenummern in CASCADE-RS im FMB-KE angelegt, dies geschieht unabhängig vom Verfahren (mit/ohne Stückenummern).

Es geschieht immer dann, wenn Bestand geschaffen wird, d. h. bei Neuzulassung Globalurkunde oder bei Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde oder bei Valutierung.

- Weiterleitung an die Aktienregister

Nach erfolgreicher Buchung werden der valutierte Betrag und die Stückenummern an das Aktienregister weitergeleitet.

13.3.2 Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde

Der Vorgang läuft wie die Neuzulassung Rahmenurkunde ohne Valutierung, wenn gleichzeitig mit der Einbuchung der Rahmenurkunde eine Teilvalutierung erfolgt.

Der Vorgang läuft wie die Neuzulassung Globalurkunde weiter. Beispielsweise wird die Umstellung von Inhaber- in Namensaktien abhängig von der Art der Urkunde (Rahmen- oder Globalurkunde) mit Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde oder Neuzulassung Globalurkunde vorgenommen. Auch die Kapitalerhöhungen aus bedingtem Kapital bzw. Kapitalmaßnahmen generell laufen so ab.

- Erfassung Einlieferungsauftrag

Auftrag zur Einbuchung der Rahmenurkunde

  - Nominale Urkunde (Auftragsnominale) größer 0 und kleiner gleich Rahmennominale
  - Einlieferungsart 4 (Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde)
  - Einlieferungsgrund 3 (Kapitalerhöhung bedingt - Optionsscheinausübung)
    oder 2 (Kapitalerhöhung gegen Einlage) oder
    oder 7 (Gratisaktien)
  - Rahmennominale (größer 0)
  - Ordnungsnummer
  - WKN des Rechts, Ex-Tag/Beginn und Datum KE (nur bei Einlieferungsgrund 3)
  - Stückelung plus Stückenummern
- Kontrolle Einlieferungsauftrag
- Freigabe zur Buchung durch ONF

Nach der Freigabe zur Buchung wird in CARAD die Urkunde angelegt. Die Urkunde ist damit "teilerfasst".

- Funktionen in CASCADE RS

Bei Einlieferungsgrund 3 wird der KE-Typ angelegt mit der WKN des Rechts plus Ex-Tag plus Datum KE, da es sich hier um eine Valutierung handelt. Bei bedingtem Kapital sind diese drei Felder vorhanden und gefüllt. FMB KE entsteht, da mit der gleichzeitigen Valutierung Bestand geschaffen wird.

Die Stückenummern werden in RS im FMB-KE angelegt.

- Weiterleitung KE-Typ an das Aktienregister

Bei Einlieferungsgrund 3 wird der KE-Typ (Stand der Kapitalerhöhung) an die Aktienregister gemeldet. Das betrifft die valutierten Bestände und die Stückenummern. In der Regel werden der KE-Typ, das Datum-KE, die Nominale und die Stückenummern weitergeleitet.

13.3.3 Neuzulassung Rahmenurkunde ohne Valutierung für bedingtes Kapital

Im Fall "Neuzulassung Rahmenurkunde ohne Valutierung für bedingtes Kapital" sind die Daten für die Stammgattung in WSIS/GE bereits vorhanden. Im Vorfeld der bedingten Kapitalerhöhung muss die WKN (falls ungleich Stammgattung, d. h. falls KE-Typ von Stammgattung abweicht) eröffnet werden; diese wird für den KE-Typ benötigt. Ggf. kommen noch weitere Informationen zu der Optionsanleihe oder dem Optionsschein, der/die das bedingte Kapital verbrieft, maschinell über WM. ORS prüft, ob die Informationen in WSS korrekt sind. Die Stammgattung existiert bereits. Da sie für den KETyp benötigt wird, wird geprüft, ob es z. B. die Optionsanleihe in WSS gibt. Dieser Fall geht immer ohne Stückelungen/Stückenummern, d. h. Stückenummern sind hier nicht möglich. Die Plausibilitäten erlauben hierauf keine laufende Einlieferung, da es sich um neu geschaffenes Kapital handelt und lediglich ein Rahmen angelegt wird.

- Erfassung Einlieferungsauftrag

Auftrag zur Einbuchung der Rahmenurkunde ohne Valutierung in KVEW/NV

  - Nominale Urkunde (Auftragsnominale) gleich 0
  - Einlieferungsart 3 (Neuzulassung Rahmenurkunde)
  - Einlieferungsgrund 3 (Kapitalerhöhung bedingt - Optionsscheinausübung)
    oder 2 (Kapitalerhöhung gegen Einlage) oder
    oder 7 (Gratisaktien)
  - Rahmennominale (Limit der Urkunde) größer 0
  - Ordnungsnummer
  - WKN des Rechts
  - Ex-Tag/Beginn
- Kontrolle Einlieferungsauftrag
- Funktionen in CASCADE-RS

Wenn die Prüfung auf KE-Typ okay ist, erfolgt – ausgelöst durch die Überleitung zur Buchung des Auftrages -die Anlage des KE-Typs.

Der KE-Typ wird angelegt mit der WKN des Rechts und dem Ex-Tag.

- Spätere Valutierung

Die Urkunde erhält Bestand über eine spätere Valutierung.

13.3.4 Neuzulassung Rahmenurkunde für laufende Einlieferung von Namensaktien

Inhaltlich werden die Neuzulassung Rahmenurkunde für laufende Einlieferung und die Neuzulassung ohne Valutierung über denselben Vorgang abgewickelt. Sie wurden allerdings in der Darstellung getrennt, da aus dem Einlieferungsgrund "4" für die Rahmenurkunde für laufende Einlieferung eine unterschiedliche Verarbeitung resultiert.

Fachlich steht hinter diesem Fall die GS-Aufnahme durch Ersteinlieferung. Es sind physische Urkunden vorhanden, die eingereicht werden. Namensaktien, die in Streifband verwahrt werden, sollen in GS überführt werden. Dieser Vorgang ist nur anwendbar, wenn die Gattung auch schon vorher eine Namensaktie war und jetzt in GS überführt werden soll. Sowohl die Ersteinlieferung vor GS-Stichtag als auch die laufende Einlieferung nach GS-Stichtag werden über diesen Vorgang abgewickelt.

In diesem Fall wird vor GS-Stichtag zu Beginn der Ersteinlieferungsphase vom Leadmanager die zu dieser Zeit noch STR-verwahrte Gattung als „für GS vorgesehen" im Feld „Verwahrmöglichkeit neu" eingepflegt.

Dies ist eine reine Information. Vor Beginn der Ersteinlieferungsphase ist zum GS-Stichtag folgende Änderung notwendig. Das WM-Band fließt immer abends in die Verarbeitung ein. Daher muss in diesem Fall manuell eingegriffen werden, und zwar durch ONF am Freitag vor dem GS-Stichtag (Montag) nach RTS-Ende zwischen 18:00 Uhr und 19:00 Uhr. Die entsprechenden Änderungen mit dem WM-Band kämen am Donnerstagabend zu früh und am Freitagabend zu spät. Die in der Maske fett gekennzeichneten Felder werden gepflegt. ORS gibt ONF die Ausprägungen vor gemäß Umstellungsfahrplan.

Diese Änderungen zu diesem Zeitpunkt bewirken, dass die bis dahin gepufferten Einlieferungsaufträge am selben Abend in STD verarbeitet werden.

- Erfassung Einlieferungsauftrag

Der Auftrag zum Anlegen der Rahmenurkunde wird vor dem GS-Stichtag in CASCADE KVEW/NV erfasst, und zwar entweder durch den Kunden oder durch ONF.

  - Nominale Urkunde (bei RS-Gattungen gleich Auftragsnominale) gleich 0
  - Einlieferungsart 3 (Neuzulassung Rahmenurkunde)
  - Einlieferungsgrund 4 (Rahmenurkunde Ersteinlieferung RS)
  - Rahmennominale (Rahmen dieser Urkunde, d. h. der höchste zu valutierende Betrag für diese Urkunde) gefüllt (das Emissionsvolumen ist aus den WSS-Stammdaten ersichtlich; ONF prüft gegen Satzung/Registerauszug, dass die Rahmennominale (bzw. die Summe bei Aufteilung auf zwei oder mehr Urkunden) nicht höher als das Grundkapital ist; die Aufteilung auf mehrere Urkunden ist Kundenwunsch)
  - Ordnungsnummer (fortlaufende Nummer der Globalurkunde) gefüllt
  - ohne Stückelungen/Stückenummern (Stückenummern können bei dieser Art der Neuzulassung nicht erfasst werden)
  - Vorbelegung Settlement-Day (ist nicht überschreibbar):
  - vor dem (technischen) GS-Stichtag mit dem GS-Stichtag
  - nach dem (technischen) GS-Stichtag mit dem Tagesdatum

- Kontrolle Einlieferungsauftrag

Der erfasste Einlieferungsauftrag muss kontrolliert werden (Vier-Augen-Prinzip). Dazu stehen in der Transaktion KVEC unterschiedliche Funktionscodes zur Verfügung.

- Annahme der eingelieferten Urkunden

Dienstag oder Mittwoch vor GS-Stichtag liefert der Leadmanager die physische Urkunde bei CBF ein.

- Freigabe zur Buchung durch ONF

Nach erfolgter Effektenannahme muss in ONF der Auftrag manuell zur Buchung freigegeben werden (KPZS/FE).

ONF prüft, ob die eingelieferten Urkunden zugelassen werden können. Dass ONF den Auftrag nicht freigeben kann, kommt bei Namensaktien selten vor. Dies kann z. B. der Fall sein, wenn die Stückelung nicht hinterlegt oder wenn der Buchungsbeleg falsch ist. Dann erfolgt eine Rückgabe an den Kunden über KPZS/RE. Diese ist aber nur möglich, solange noch keine Freigabe erfolgt ist, d. h. zwischen Effektenannahme und Freigabe. Die Urkunden bleiben in ONF. Der Einlieferungsauftrag wird elektronisch gelöscht und muss neu erfasst werden.

Bei Einlieferungsart 3 (Neuzulassung Rahmenurkunde) und 4 (Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde) ist die Freigabe nur möglich, wenn die im Auftrag eingetragene Ordnungsnummer noch nicht in CARAD vorhanden ist. Andernfalls wird die Freigabe mit der Fehlermeldung KV0541F “Zustimmung/Freigabe nicht möglich – Ordnungsnummer schon in CARAD vorhanden” abgelehnt.

- Funktionen in CASCADE-RS

Es sind in diesem Fall keine Aktivitäten in CASCADE-RS zu tun. Es entsteht kein KE-Typ, da lediglich ein Rahmen angelegt wird. Erst zum Zeitpunkt der Einlieferung wird durch den Wechsel der Verwahrart Bestand geschaffen.

13.3.5 Funktion Valutierung - RS

Die erstmalige Valutierung bei RS-Gattungen geschieht in der Regel durch die Buchung von RS-Erst- und lfd. Einlieferungen in RS per bzw. ab GS-Stichtag und dem Heraufschreiben der bei der CBF hinterlegten Rahmenurkunde.

Die Valutierung von Namensaktien aus bedingter Kapitalerhöhung wird analog Inhaberaktien vorgenommen. Zusätzlich zum möglichen KE-Typ, ist das Datum der Kapitalerhöhung (Datum-KE) zu erfassen. Bei der Valutierung von RS-Gattungen ist immer die Eingabe von Stückenummern erforderlich.

Valutierungen sind bei Rahmenurkunden oder valutierten Rahmenurkunden möglich.

Vor GS-Stichtag:

- Erfassung einer Valutierung ist möglich (die Buchung erfolgt erst am GS-Stichtag)

Nach GS-Stichtag: Schaffung von Beständen

Valutierung in CASCADE KVEW/NV mit folgenden Daten:

- Erfassung KVEW/NV
  - Zu valutierende Nominale (Auftragsnominale)
  - Einlieferungsgrund: 3 oder 2 oder 7
  - Einlieferungsart: 5
  - WKN des Rechts
  - Ex-Tag Beginn
  - Datum KE (bei EG 3 JA, bei EG 2 und 7 NEIN)
  - Ordnungsnummer
  - Stückelung und Stückenummern

Der Auftrag wird in folgenden Schritten durchgeführt:

- Kontrolle KVEC
- Freigabe KPZS (dadurch systemseitige Prüfung, ob noch nicht valutierte Nominale im Rahmen ausreicht)
- Buchung: Durch die Buchung wird in CASCADE-RS FMB-KE geschaffen, und es werden Stückenummern diesem Bestand zugeordnet. Die Zuordnung der Stückenummern erfolgt sowohl im Verfahren "Mit" als auch "Ohne Stückenummern".
- Automatische Meldung an das Aktienregister durch CASCADE-RS mit folgenden Daten: Art der KE (bedingt oder unbedingt), Ex-Tag, WKN des Rechts und ggf. Datum KE, Nominale, Stückelung und Stückenummern

Das Hochschreiben der Rahmenurkunde erfolgt analog der Vorgehensweise für die Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde.

Valutierungen von RS-Gattungen können nicht storniert werden.

13.4 Die Auslieferung von Namensaktien (RS) nach dem GS-Stichtag

Auslieferungen in Namensaktien sind nicht über die Auftragsart Auslieferung möglich.
Siehe CASCADE Handbuch Band 2, Kapitel 3.

14 TEFRA D Anleihen

14.1 Einlieferung der Urkunden

TEFRA D Anleihen haben die Eigenart, dass in den ersten 40 Tagen nach der Emission diese Wertpapiere nicht von US-Residents gekauft werden dürfen. Aus diesem Grund wird die Emission zuerst auf ein Sperrkonto xxxx/671 gebucht und müssen dann von den einzelnen Banken für ihre "Nicht-US-Resident-Kunden" von dort freigegeben und auf das entsprechende Hauptkonto der Bank umgebucht werden.

Um diesen Prozess auch systemtechnisch darstellen zu können, muss der Emittent bei der Emission der Anleihe 2 Rahmenurkunden mit der Urkundennominale = 0 in der Auftragsart 16 (Neuzulassung RU), über die Transaktion KVEW-NV, über LIMA oder EDT; Einlieferungsart 3 = NEUZULASSUNG RU oder 4 = NEUZULASSUNG RU VA, bei der CBF einliefern. Beide Rahmenurkunden erhalten die Rahmen-Nominale = Emissionsvolumen.

Das Verfahren der Einlieferung bei Neuzulassungen und Valutierungen ist im Kapitel Erfassung Neuzulassung/Valutierung (NV) auf Seite 12-16 beschrieben. Die erste (vorläufige) Rahmenurkunde erhält die Ordnungsnummer = 1 mit Einlieferungsgrund 1 (aus Emission → Valutierung und Revalutierung möglich), die zweite (finale) Rahmenurkunde erhält die Ordnungsnummer = 2 und wird mit dem Einlieferungsgrund = 8 ("SPERRE, REVAL.MOEGL.") eingeliefert. Dieser Schlüssel verhindert, dass die finale Urkunde während der TEFRA D Frist valutiert werden kann.Daraus folgt, dass vorerst (während der 40-Tage-Frist) nur die vorläufige Rahmenurkunde valutiert/revalutiert werden kann.

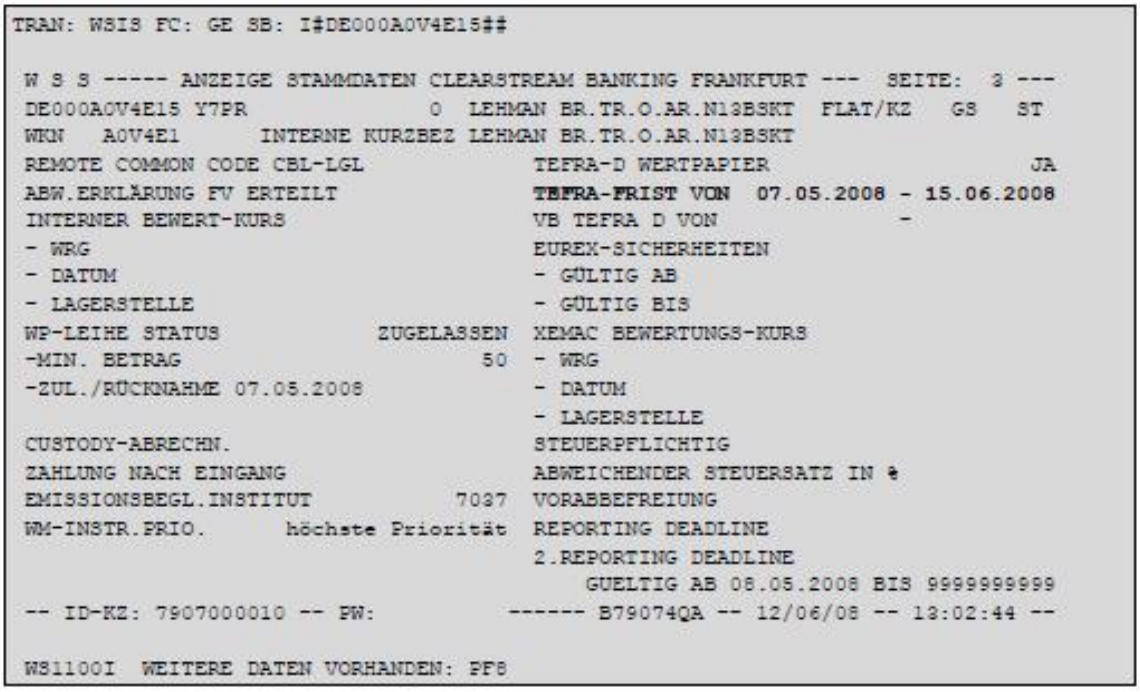
14.1.1 Aufstockung des Emissionsvolumen einer TEFRA D Gattung

Durch die Möglichkeit der Lieferung von mehreren Urkunden in einer als TEFRA D definierten ISIN, kann der CBF-Kunde bei Bedarf das Emissionsvolumen der Gattung erhöhen. Für die Lieferung weiterer Urkunden zur Aufstockung des Emissionsvolumens von TEFRA D Gattungen gelten folgende Voraussetzungen:

- Zu TEFRA D Gattungen müssen grundsätzlich, über die Transaktion KVEW-NV, über LIMA-DFÜ/ SWIFT oder EDT zwei Urkunden bei CBF eingereicht werden (Einlieferungsart 3 = NEUZULASSUNG RU + 4 = NEUZULASSUNG VAL. RU). Das betrifft nicht nur die Einlieferung der Urkunden bei Beginn der TEFRA D Frist (Ersteinlieferung), sondern auch für jede weitere Einlieferung wegen Aufstockung des Emissionsvolumens. Es muss also eine "vorläufige" Urkunde mit Einlieferungsgrund 1 "AUS EMISSION" und eine "endgültige" Urkunde mit Einlieferungsgrund 8 "SPERRE, REVAL.MOEGL." eingereicht werden.
- Die Ordnungsnummern der zur Aufstock eingereichten Urkunden dürfen in dieser Gattung noch nicht hinterlegt sein. D.h. wurden bei der Ersteinlieferung die Ordnungsnummern 1 (Vorläufige Urkunde) und 2 (Finale Urkunde) vergeben, so sollte für die Aufstockung die Ordnungsnummern 3 (Vorläufige Urkunde) und 4 (Finale Urkunde) vergeben werden.
- Die TEFRA D Frist der Gattung, wird durch das Aufstocken des Emissionsvolumen nicht beeinträchtigt. Auf Antrag des Kunden kann, bei einer Aufstockung, die TEFRA D Frist für die entsprechende Gattung verlängert werden.
- Es ist unbedingt darauf zu achten, dass Aufstockungen und Fristverlängerungen spätestens zwei Bankarbeitstage vor dem TEFRA D Fristende einzureichen sind. Hier sind die möglichen Feiertage berücksichtigen.

14.2 Umlegung nach Frist-Ablauf

Die TEFRA D Frist wird in WSS im Feld GS130+131 (TEFRA D FRIST VON – BIS) dargestellt. Eine Änderung der TEFRA D Frist ist bis zu einem Bankarbeitstag vor dem aktuellen Fristende möglich. Änderungen am TEFRA D Fristende und danach können für die automatisierten Vorgänge nicht mehr berücksichtigt werden.



14.2.1 Automatische Änderung der Einlieferungsgründe nach Ablauf der TEFRA D Frist

Nach Ablauf der 40-tägigen (Kalendertage) TEFRA D Frist sollen keine Valutierungen (mark ups) mehr auf der "vorläufigen" bis zu Rahmenurkunde möglich sein. Ab dem 41. Kalendertag muss die Sperre der "finalen" Urkunde aufgehoben werden, so dass eine Valutierung möglich ist.

Hierzu werden die Einlieferungsgründe für die vorläufigen Urkunden und finale Urkunden systemseitig geändert:

- Die vorläufige Urkunde von Einlieferungsgrund 1 (aus Emission) auf Einlieferungsgrund 8 (Sperre, Revalutierung möglich). Somit ist eine Valutierung auf diese Urkunde nicht mehr möglich.
- Die finale Urkunde von Einlieferungsgrund 8 (Sperre, Revalutierung möglich) auf Einlieferungsgrund 1 (aus Emission). Somit ist sind Valutierungen und Revalutierungen auf diese Urkunde möglich.

Die Änderung der Einlieferungsgründe wird automatisch zum Ende der TEFRA D Frist mit Gültigkeit zum nächsten Valutatag vollzogen. Es werden nur Urkunden berücksichtigt, die den CARAD Status "K = kontrolliert" aufweisen. Somit ist für TEFRA D Gattungen keine Änderung der Einlieferungsgründe in den CARAD-Transaktionen mehr möglich.

Bei zukünftigen Valutierungen (mark ups) wird zu Ermittlung der freie Nominale (Differenz zwischen Rahmennominale und bereits valutierten Nominale einer Gattung) auch die noch gesperrten Bestände herangezogen.

14.2.2 Automatische Umbuchung der CARAD Bestände über CASCADE-Auftrag AA 18

Nach Ende der TEFRA D Frist plus drei Bankarbeitstage müssen die "freigegebenen" Nominal-Bestände von der vorläufigen Urkunde auf die endgültige Urkunde automatisch umgelegt werden. Dies wird über einen automatisch generierten CASCADE Auftrag AA 18 (Auslieferung) mit der Spezifizierung Umlegung "KZ - 6 UMBUCH-RU" vollzogen werden.

Hierzu wird ein Umlegungsauftrag mit Nominale in Höhe der freigegebenen Bestände generiert. Dadurch werden die vorhandenen vorläufigen Urkunde nach bestimmter Priorität in Summe um die Auftragsnominale revalutiert und die Valutierung der finalen Urkunden ebenso nach bestimmter Priorität in Summe der Auftragsnominale vorgenommen.

Die auf dem Unterkonto 671 befindlichen Bestände werden hierbei nicht mit umgestellt und verbleiben somit auf der vorläufigen Urkunde.

Bei zukünftigen Valutierungen (mark ups) wird zu Ermittlung der freie Nominale (Differenz zwischen Rahmennominale und bereits valutierten Nominale einer Gattung) auch die noch gesperrten Bestände herangezogen.

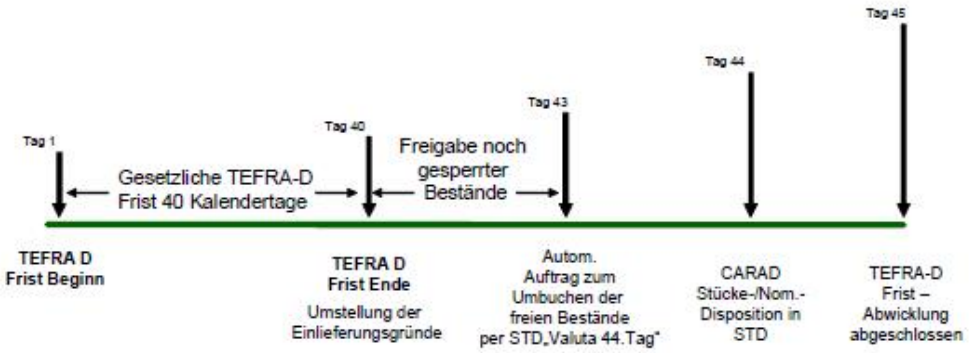
14.2.3 Manuelle Umbuchung der CARAD Bestände über CASCADE-Auftrag AA 18 nach Ablauf der TEFRA D Frist

Die gesperrten Bestände können auch nach Ablauf der Frist über den Lead-Manager noch freigegeben werden.

Anschließend muss dann jeweils durch den Lead-Manager der freigegebene Bestand mittels eines manuell eingegebenen "Umlegungs"-Auftrages auf die finale Rahmenurkunde umgelegt werden.Die vorläufige

Rahmenurkunde kann nur ausgeliefert werden, wenn diese zuvor auf "0" heruntervalutiert wurde, d. h. es sind keine Rest-Bestände mehr auf irgendeinem 671er-Konto vorhanden.

14.2.4 Timeline TEFRA D



Leerseite

15 Electronical documentation transfer EDT

CBF bietet neben der üblichen physischen Einlieferung von Globalurkunden bei Neuzulassung auch den Weg über das "EDT-Verfahren" an. Bei diesem Verfahren ist es nicht mehr notwendig, eine Globalurkunde in gedruckter Form physisch bei CBF einzuliefern. Stattdessen wird eine Globalurkunde als PDF-Datei als X-List-Internet-Upload an die CBF-Abteilung New Issues geschickt und nach erfolgter Zulassungs-Prüfung gebucht.

Diese PDF-Datei wird nach erfolgter Zulassung an den Tresor weitergeleitet, dort ausgedruckt und nach einer weiteren Prüfung von einem Vaults-Mitarbeiter mit einer Kontroll-Unterschrift versehen und in die GS-Verwahrung genommen.

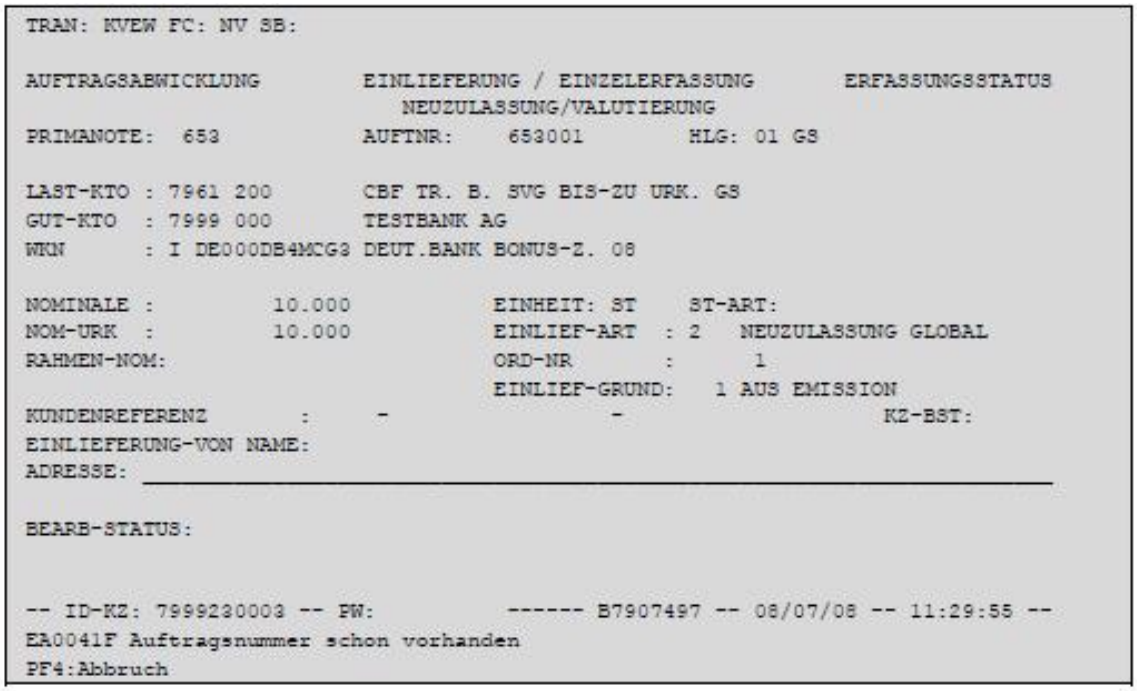
Parallel hierzu wird vom Einreicher ein CASCADE- (LIMA-DFUE-) Neuzulassungs-Auftrag eingestellt. Anstelle einer Auftragserteilung über CASCADE- (LIMA-DFUE-) kann dies auch über einen elektronischen Upload via Excel-/CSV-Datei vorgenommen, werden, wenn sich der Kunde für diesen Service bei CBF registriert hat.

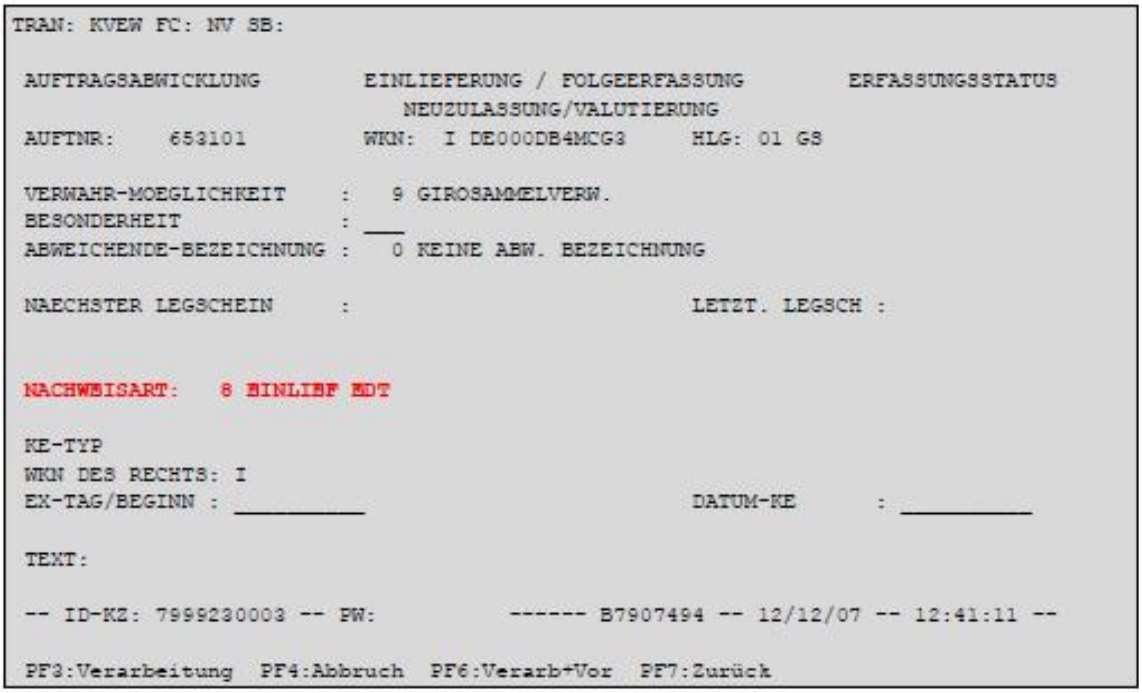
Wenn sich eine Bank für das EDT-Verfahren entschieden hat, dann werden alle zukünftigen Neuzulassungen innerhalb von bestimmten Wertpapier-Gruppen (WSS-Tabelle G06) automatisch über das neue Verfahren abgewickelt. Bei Neuzulassungs-Aufträgen nach dem EDT-Verfahren wird das Feld NACHWEISART automatisch mit dem Wert "8 –Einlieferung EDT" gefüllt, um diese Aufträge eindeutig identifizieren zu können.

Die Ordnungsnummer wird automatisch mit "1" vorbelegt.

Nähere Auskünfte zum EDT-Verfahren erteilt der Clearstream Banking CSD Client Services Core Products and Connectivity.

Beispiel zur Online-Erfassung einer EDT-Einlieferung:





Sollte im Ausnahmefall einmal eine Globalurkunde physisch eingeliefert werden, dann kann die Nachweisart in der CBF-Prüfstelle auch geändert werden.

Zum EDT-Verfahren zugelassene Instrumentenarten (GD198C):

Warrants and Certificates

Instrument type GD198C (GF1)	Beschreibung
2821	Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur
3001	Warrants
3101	Covered Warrants
4001	Zertifikate auf Wertpapiere
4002	Zertifikate auf Indizes
4003	Zertifikate auf Rohstoffe
4004	Zertifikate auf Währungen
4005	Zertifikate auf Zinssätze
4006	Zertifikate auf sonstige Werte
4007	Zertifikate auf Futures

Bonds

Instrument type GD198C (GF1)	Beschreibung
2001	Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur
2008	Warrants
2022	Covered Warrants
2031	Zertifikate auf Wertpapiere
2201	Zertifikate auf Indizes
2204	Zertifikate auf Rohstoffe
2205	Zertifikate auf Währungen
2206	Zertifikate auf Zinssätze
2209	Zertifikate auf sonstige Werte
2210	Zertifikate auf Futures
2801	Anleihen mit zertifikationsähnlicher Struktur
2821	Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur
2892	An.zert.-ähn.Str.MRZ<80%
2896	LB zert.-ähn.Str.MRZ<80%

Leerseite

16 Autodispo-Service

16.1 Einführung der automat. Valutierung und Revalutierung für Zertifikate, Optionsscheine und definierte Anleihen

CBF bietet mit einem neuen Produkt seinen Kunden die Möglichkeit, für Emissionen von Zertifikaten; Optionsscheinen und definierte Anleihen sowohl eine effiziente und zeitnahe Bestandsdisposition als auch eine möglichst hohe Settlement-Sicherheit für CASCADE-Instruktionen der Auftragsart 01 (WP Übertrag – Wertpapier-Übertrag mit und ohne Gegenwertverrechnung) zu gewährleisten.

Hierdurch ist für die Valutierung bzw. Revalutierung des jeweiligen Emissionsvolumens unter Berücksichtigung der Rahmennominale ein automatisierter straight-through-process (STP) implementiert.

Charakteristisch für den neuen Service ist eine von CBF im Auftrag des Kunden erfolgende automatisierte Disposition der Depotbuchbestände ("mark up" – Valutierung), die durch die jeweils zur Ausführung in CASCADE eingestellten Verkaufsinstruktionen zu börslichen und außerbörslichen Wertpapiergeschäften gesteuert wird. Ein Abräumen („mark down" – Revalutierung) der zum Ende des Tages vorhandenen Depotbuchbestände stellt zudem sicher, dass vom emissionsbegleitenden Institut nicht verkaufte Anteile nicht auf dem Depotbestandskonto geführt werden.

Clearstream Banking Frankfurt wird alle interessierten Kunden, die über eigene Konten in Zertifikate, Optionsscheine und bestimmte Anleihen begeben oder als emissionsbegleitendes Institut darin eingebunden sind, einzeln in dem Prozess der Einführung beraten und begleiten.

Nähere Auskünfte zum „AutoDispo-Prozess" erteilt der Clearstream Banking CSD Client Services Core Products and Connectivity.

16.2 Prozessvoraussetzungen

Für den Prozess ausschlaggebende Eckpunkte sind:

- Ein auf den Kunden lautendes CASCADE Hauptkonto.
  - Zugelassene Wertpapiergruppen aus der Klasse der Zertifikate und der verbrieften Optionsscheine sowie definierte Anleihen;
  - der Kunde fungiert als Emissionsbegleitendes Institut (EBI) für die berechtigten Gattungen;
  - die Wertpapiere einer Gattung müssen in einer oder mehreren Bis-Zu Globalurkunden verbrieft sein;
  - Emittenten-Nummer.
- Auf dem Hauptkonto dürfen nur Eigenbestände geführt werden. Unterkonten werden nicht berücksichtigt.
- Gattungen, die nach ihren Bedingungen vorübergehend oder dauerhaft besonderen Überwachungspflichten oder Verfügungsbeschränkungen, insbesondere TEFRA-D-Regelungen, unterliegen, Namenswertpapiere oder Global Bonds sind generell von der Einbeziehung in den AutoDispo Service ausgeschlossen.
- Gattungen, die für den neuen Prozess zugelassen wurden, können sowohl durch die automatische Generierung als auch über die herkömmliche Auftragserteilung valutiert und revalutiert werden.
- Für den neuen Service-Prozess stehen die standardisierten CASCADE Auswertungen und Reports zur Verfügung. Via SWIFT können die MT535 Bestandsmeldungen sowie MT536 Settlement-Statements zur Verfügung gestellt werden (siehe Connectivity Handbuch 2.1.5 ff).
- Für die CASCADE Auftragsarten 16 und 18 können von CBF-Kunden LIMA - Queries angefordert werden (siehe CBF Connectivity Handbuch).

17 Änderung/Löschung (EB)

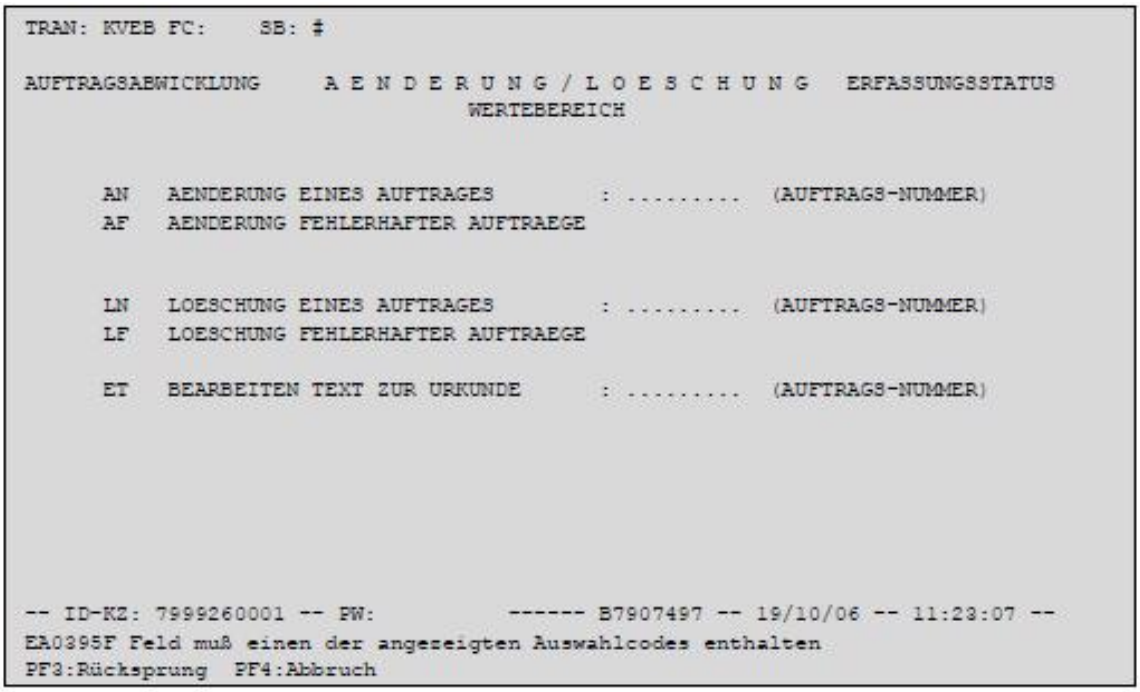
17.1 Änderung von Aufträgen

(A) Allgemeine Beschreibung

Ein Auftrag kann im Erfassungsstatus nur dann geändert werden, wenn er noch nicht kontrolliert oder wenn er bei der Kontrolle als fehlerhaft gekennzeichnet wurde. Es können sowohl bereits vorhandene Daten durch Überschreiben der alten Feldinhalte geändert als auch neue Daten durch Füllen leerer Felder hinzugefügt werden.

Mit diesem Vorgang werden auch die im Auftragsstatus zur Änderung markierten und daraufhin in den Erfassungsstatus generierten Aufträge bearbeitet. Dies beinhaltet ebenfalls die von der CBF als fehlerhaft an die Bank zurück generierten Aufträge. Diese müssen zumindest zur Änderung geöffnet werden und wieder gespeichert und danach kontrolliert werden. Eine direkte Kontrolle ist nicht möglich. Ob der Auftrag aber vor der erneuten Kontrolle wirklich geändert wurde, wird nicht geprüft. Über die Funktion Änderung im Erfassungsstatus können auch unvollständig erfasste Aufträge über die Auftragsnummer weitererfasst werden. Die Eingabe erfolgt analog der Ersterfassung.

(B) Hauptauswahl Änderung/Löschung Erfassungsstatus Wertebereich


TRAN: KVEB FC: SB: #
AUFTRAGSABWICKLUNG A E N D E R U N G / L O E S C H U N G ERFASSUNGSSTATUS
WERTEBEREICH
AN AENDERUNG EINES AUFTRAGES : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
AF AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
LN LOESCHUNG EINES AUFTRAGES : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
ET BEARBEITEN TEXT ZUR URKUNDE : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
-- ID-KZ: 7999260001 -- PW: ------ B7907497 -- 19/10/06 -- 11:23:07 --
EA0395F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Die Funktion ET ist den Mitarbeitern der CBF vorbehalten und kann von Kunden nicht beantragt werden.

17.1.1 Änderung fehlerhafter Aufträge (AF)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg "AF" werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt. Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung. Hier können nur die buchungsrelevanten Felder wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt, d. h. in dieser Kurzanzeige kann nicht geändert werden.

(B) Tabellarische Anzeige/Änderung Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEB FC: AF SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG            AUFTRAEGE / AENDERUNG            ERFASSUNGSSTATUS

                                                                        SEITE   1

KZ PRIM  AUFTR-NR LAST-KTO GUT-KTO  WKN                NOMINALE

_   653   6530000 7960 000 7930 000 DE0007224008          1.000

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:03:11 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

"X" Selektion des Auftrages zur Änderung

Es ist jeweils nur ein "I" bzw. ein "X" auf einer Maskenseite erlaubt, d.h. es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden.

"X" und "I" dürfen auch nicht miteinander kombiniert werden.

Der einzige Unterschied zwischen "X" und "I" besteht darin, dass man nach "I" nicht ändern kann, während man nach "X" den Auftrag in der Vollanzeige ändern darf.

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

Zur Änderung wird der gewünschte Auftrag durch Eingabe eines "X" in der Spalte KZ der entsprechenden Zeile ausgewählt.

(D) Vollanzeige/Änderung Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEB FC: AF SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE:  653           AUFTNR:   6530000       HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0007224008 SEDLMAYR S.-FR.KGAAO.N.

NOMINALE :          1.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          1.000          EINLIEF-ART  : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                                   EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ       :     -              -                  KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT:

BEARB-STATUS:  10 EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU WENIG STUECKE


-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:03:59 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Diese Maske gilt ebenfalls für die Auftragsarten Neuzulassung/Aufstockung, Valutierung. In dieser Vollanzeige sowie der Vollanzeige für die Folgemasken können jetzt die vorgesehenen Änderungen eingegeben werden. Neben der Prüfung, ob alle Mussfelder vorhanden sind, werden die Eingaben auf formale Richtigkeit und auf gültige Abhängigkeiten zueinander geprüft. Gleiches gilt für die Kennzeichen zur Bearbeitung der Stückenummern in den Einlieferungsaufträgen.

Hinweis:

Sind in einem Auftrag bereits Stückenummern erfasst, dann können die Auftragsnummer, WKN/ISIN, der Einlief-Grund und die zugehörige Stückelung nicht mehr geändert werden.Nach der Verarbeitung mit PF3 kehrt das System zur tabellarischen Kurzanzeige zurück, in der der Benutzer den nächsten zu ändernden Auftrag auswählen kann. Nach der Änderung eines fehlerhaften Auftrages wird dieser Auftrag aus der tabellarischen Anzeige entfernt, da er jetzt nicht mehr als fehlerhaft gilt. Sind alle fehlerhaften Aufträge abgearbeitet, kehrt das System automatisch in die Menümaske zurück.

Sonderfall:

Wurde ein Auftrag von der CBF-Prüfstelle mit der Nachweisart = “2” (Urkunden liegen vor) zurückgewiesen, dann ist das Feld nicht zu ändern. Die Urkunden wurden nicht an den Einreicher zurückgegeben, der Auftrag muss allerdings vom Kunden in Abstimmung mit CBF abgepasst werden.

17.1.2 Änderung eines Auftrages über die Auftragsnummer (AN)

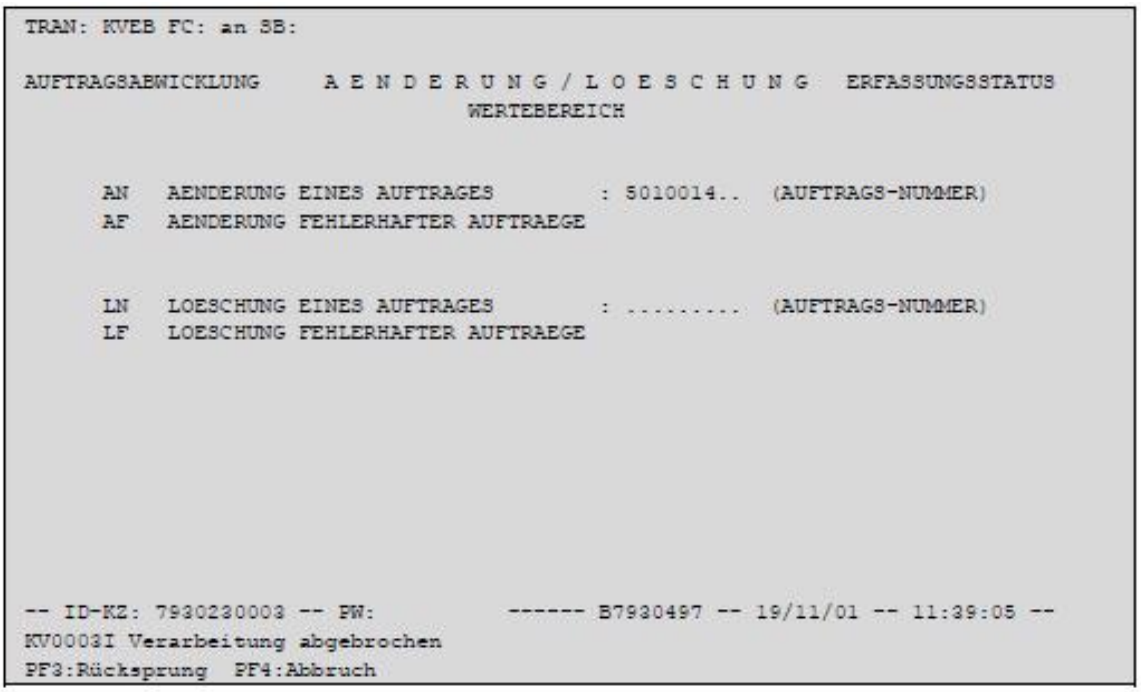
(A) Allgemeine Beschreibung

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu ändernden Auftrages, steigt er mit dem Transaktionscode KVEB und dem Funktionscode “AN” sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die Vollanzeige aller bisher gespeicherten Daten dieses Auftrages.

Unter “AN” sind folgende Aufträge änderbar:

- ein noch nicht kontrollierter Auftrag,
- ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag,
- ein aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag,
- ein noch nicht vollständig erfasster Auftrag,

(B) Hauptauswahl Änderung/Löschung Erfassungsstatus Wertebereich


TRAN: KVEB FC: an SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG A E N D E R U N G / L O E S C H U N G ERFASSUNGSSTATUS
WERTEBEREICH
AN AENDERUNG EINES AUFTRAGES : 5010014.. (AUFTRAGS-NUMMER)
AF AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
LN LOESCHUNG EINES AUFTRAGES : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
-- ID-KZ: 7930230003 -- PW: ------ B7930497 -- 19/11/01 -- 11:39:05 --
KV0003I Verarbeitung abgebrochen
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

(C) Änderung Kennzeichen SAMMELURKUNDE (J/N)

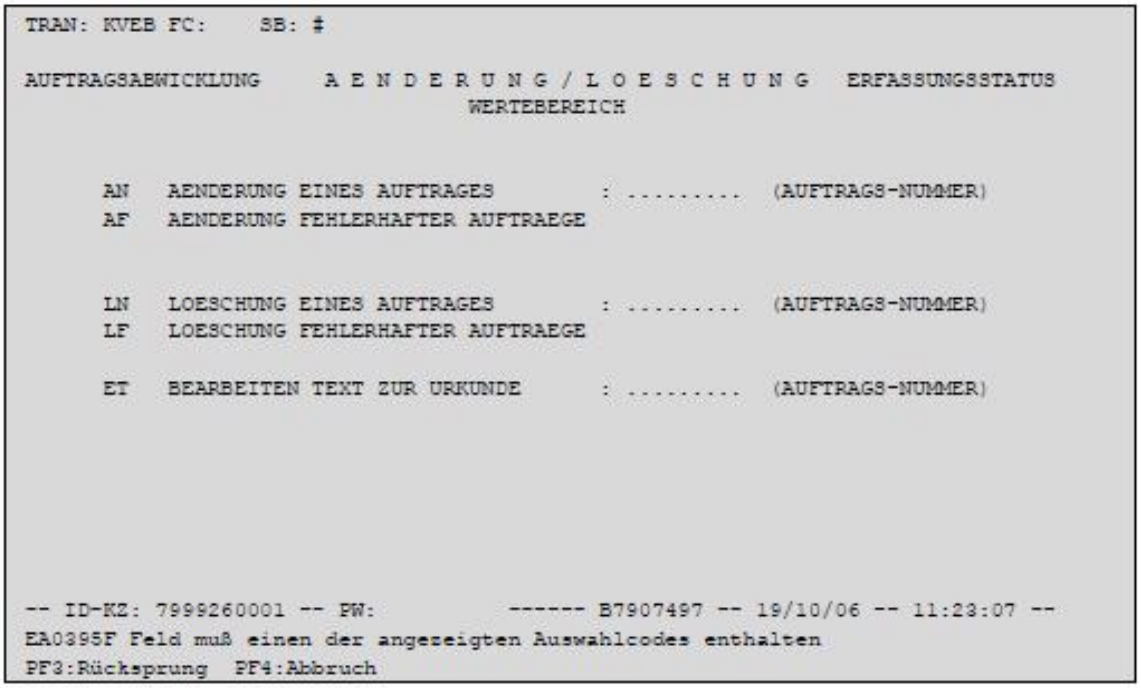
Wenn innerhalb eines Einlieferungsauftrages irrtümlich eine Sammelurkunde anstelle von Einzelurkunden (oder umgekehrt) erfasst wurde, dann ist es möglich, das Kennzeichen SAMMELURKUNDE J/N zu ändern, ohne den gesamten Auftrag löschen zu müssen.

Um dieses Kennzeichen ändern zu können, ist es allerdings erforderlich, zuerst die erfassten Stückenummern bzw. die ggfs. erfasste Ordnungsnummer zu löschen.

Nach erfolgter Änderung des Kennzeichens können die Stückenummern direkt wieder erfasst werden.

17.2 Löschung von Aufträgen

Ein Auftrag kann im Erfassungsstatus nur dann gelöscht werden, wenn er noch nicht kontrolliert, wenn er bei der Kontrolle als fehlerhaft gekennzeichnet wurde oder wenn durch CBF der Auftrag zurückgestellt wurde.


TRAN: KVEB FC: SB: #
AUFTRAGSABWICKLUNG A E N D E R U N G / L O E S C H U N G ERFASSUNGSSTATUS
WERTEBEREICH
AN AENDERUNG EINES AUFTRAGES : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
AF AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
LN LOESCHUNG EINES AUFTRAGES : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
ET BEARBEITEN TEXT ZUR URKUNDE : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
-- ID-KZ: 7999260001 -- PW: ------ B7907497 -- 19/10/06 -- 11:23:07 --
EA0395F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

17.2.1 Löschung fehlerhafter Aufträge (LF)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg "LF" werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt. Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung. Hier können nur die buchungsrelevanten Felder wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt. Nur hier in der Kurzanzeige können Aufträge gelöscht, d. h. Löschkennzeichen in den entsprechenden Zeilen gesetzt werden.

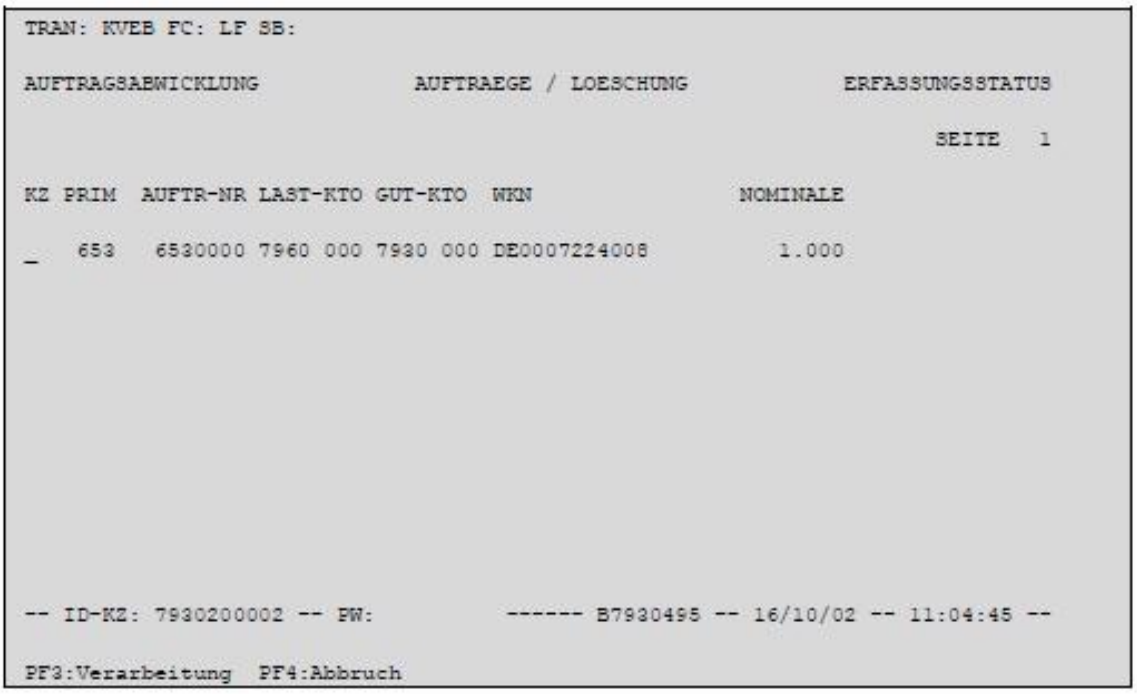
Hinweis:

Aufträge, die durch CBF-Prüfstelle in den CASCADE-Erfassungsstatus zurückgestellt wurden, können dort nicht direkt gelöscht werden. Solche Aufträge müssen zunächst kontrolliert, danach im Auftragsstatus zur Löschung in den Erfassungsstatus generiert und dort endgültig gelöscht werden.

Sonderfall:

Ein von der CBF-Prüfstelle zurückgegebener Auftrag, kann nicht direkt gelöscht werden, sondern muss geändert und kontrolliert werden. Sind die physischen Urkunden durch CBF zurückgegeben worden, kann der Auftrag zur Löschung generiert werden.

(B) Tabellarische Anzeige/Löschung Erfassungsstatus


TRAN: KVEB FC: LF SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG AUFTRAEGE / LOESCHUNG ERFASSUNGSSTATUS
SEITE 1
KZ PRIM AUFTR-NR LAST-KTO GUT-KTO WKN NOMINALE
_ 653 6530000 7960 000 7930 000 DE0007224008 1.000
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:04:45 --
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" - Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"X" - Löschung des Auftrages

Es darf jeweils nur ein "I" auf einer Maskenseite eingegeben werden, da nur ein Auftrag zur Vollanzeige selektiert werden kann.

"X" und "I" dürfen nicht miteinander kombiniert werden.

Es ist jedoch möglich, mehrere Aufträge auf einer Seite mit "X" zur Löschung zu kennzeichnen.

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

17.2.2 Löschung eines Auftrages über die Auftragsnummer (LN)

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu löschenden Auftrages, steigt er mit dem Transaktionscode KVEB und dem Funktionscode "LN" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die tabellarische Kurzanzeige der buchungsrelevanten Daten dieses Auftrages.

Im Unterschied zur Änderung eines einzelnen Auftrages wird bei der Löschung über den Einstieg "LN" die tabellarische Form des Auftrages angezeigt, da nur dort das Löschkennzeichen gesetzt werden kann.

Unter "LN" können folgende Aufträge gelöscht werden:

- ein noch nicht kontrollierter Auftrag,
- ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag.

18 Information (EI)

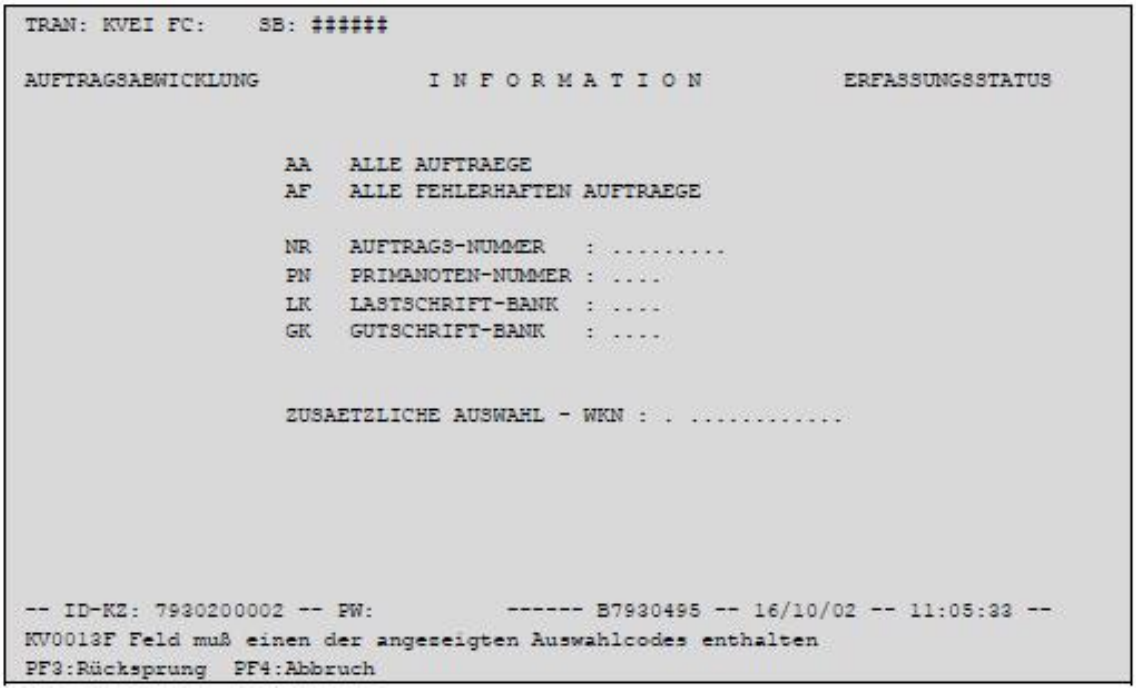
Im Informationsdienst des Erfassungsstatus können sich die Teilnehmer über selbst eingestellte Aufträge Ein- und Auslieferungen informieren. Es besteht nicht die Möglichkeit, von hier aus zu ändern oder zu löschen.

Es werden hier nur Beispielmasken für den Informationsdienst angeboten. Die Masken entsprechen den Masken aus dem Erfassungsstatus.

Der Informationsdienst bietet folgende Möglichkeiten:

Anzeige des Bearbeitungszustandes eines Auftrages (nicht kontrolliert/fehlerhaft/vollständig erfasst/ teilerfasst/zurückgegeben),

- Tabellarische Kurzanzeige mehrerer Aufträge,
- Vollanzeige eines Auftrages mit allen erfassten Informationen,
- Online Druck mit allen erfassten Informationen zu einem Auftrag in der Vollanzeige.


TRAN: KVEI FC: SB: ######
AUFTRAGSABWICKLUNG I N F O R M A T I O N ERFASSUNGSSTATUS
AA ALLE AUFTRAEGE
AF ALLE FEHLERHAFTEN AUFTRAEGE
NR AUFTRAGS-NUMMER : .....
PN PRIMANOTEN-NUMMER : ....
LK LASTSCHRIFT-BANK : ....
GK GUTSCHRIFT-BANK : ....
ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : . .....
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:05:33 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Folgende Funktionen (FC) sind möglich:

AA - Alle Aufträge

AF - Alle fehlerhaften Aufträge

NR - Auswahl nach Auftragsnummer

PN - Auswahl nach Primanoten-Nummer

LK - Auswahl nach Lastschrift-Bank

GK - Auswahl nach Gutschrift-Bank

(A) Allgemeine Beschreibung

Bei allen Abfragen erfolgt zuerst eine tabellarische Anzeige aller mit dem Funktionscode übereinstimmenden Aufträge. Angezeigt wird immer der aktuelle Zustand des Auftrages, da im Erfassungsstatus keine Historie geführt wird.

Bereits kontrollierte Aufträge sind aus dem Erfassungsstatus des Eingebers in den CASCADE-Auftragsstatus CBF übergegangen und werden im Informationsdienst des Erfassungsstatus nicht mehr angezeigt.

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an.

Möglicher Bearbeitungsstatus:

" " - nicht kontrollierter Auftrag

"F" - fehlerhafter Auftrag

"A" - aus dem Auftragsstatus zum Ändern generiert

"L" - aus dem Auftragsstatus zum Löschen generiert

Hinweis:

Beim Einstieg über den Funktionscode "AF" (fehlerhafte Aufträge) werden alle Aufträge (Ein- bzw. Auslieferungen) mit dem Bearbeitungszustand " " angezeigt, der in diesem speziellen Fall für fehlerhafte Aufträge steht.

(B) Tabellarische Anzeige/Information Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEI FC: AF SB: I##

AUFTRAGSABWICKLUNG            AUFTRAEGE / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS

                                                                      SEITE   1

K PRIM    AUFTNR LAST  GUT WKN                  NOMINALE                 GEGENWERT

   653   6530000 7960 7930 DE0007224008            1.000
   653   6530001 7960 7930 DE0007224008        1.000.000









GESAMTSUMMEN  ANZAHL AUFTRAEGE:      2        1.001.000

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:07:13 --

PF3:Ruecksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbares Kennzeichen (K):

"I" - Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit "I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

(C) Vollanzeige von Aufträgen/Information Erfassungsstatus

(C1) Beispielmaske "Lfd. Einlieferung" (gilt für andere Unterauftragsarten entsprechend)

```
TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE:  653           AUFTNR:   6530000       HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0007224008 SEDLMAYR S.-FR.KGAAO.N.

NOMINALE :          2.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          2.000          EINLIEF-ART  : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                                   EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ       :     -                -                   KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT:

BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST


-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:21:40 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Von der Vollanzeige aus kann mittels PF2 ein Online Druck des angezeigten Auftrages erfolgen. Wenn die Vollanzeige sich über mehrere Masken erstreckt, werden alle Maskeninhalte ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online Druck initiiert wurde. Dafür muss der Bildschirm leitungsbezogen dem Drucker zugeordnet sein.

```
TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / FOLGEINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR:   6530000                                  WKN:  I DE0007224008
                                                   HLG: 01 GS

VERWAHR-MOEGLICHKEIT    :   9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG :   0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :      16                  LETZT. KUPON  :         20

UEBERF KUPON        VON :                          BIS           :

NACHWEISART:   1 EINLIEF. EFF. URK.                SAMMELURKUNDE : N (J/N)



TEXT:

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:22:00 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Hinweis:

Handelt es sich bei der WKN/ISIN um einen Optionsschein, wird anstelle des “nächster Kupon” der “nächste Leg-Schein” und anstelle des ‘”letzt. Kupon” der “letzte Leg-Schein” angezeigt.

```
TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG       EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                               LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR     :   6530000                          GES-NOM  :          2.000
WKN        : I DE0007224008    ANZ-URK:       100 SUMME-NOM:          2.000
STCKL      :                10                  SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN                                                   MAN MAN E
                                                                    GEL GEL
  99996001-100, .*









-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:22:20 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Hinweis:

CASCADE verarbeitet unterschiedliche Stückelungen in einem Einlieferungsauftrag in absteigender Reihenfolge. Die zugehörigen Urkunden müssen in dieser Reihenfolge bei der CBF eingeliefert werden.

```
AUFTRAGSABWICKLUNG       EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                               LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR     :   6530000                          GES-NOM  :          2.000
WKN        : I DE0007224008    ANZ-URK:      1000 SUMME-NOM:          2.000
STCKL      :                1                   SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN                                                   MAN MAN E
                                                                    GEL GEL
  99990001-100, .*
  99990101-200, .*
  99990201-300, .*
  99990301-400, .*
  99990401-500, .*
  99990501-600, .*
  99990601-700, .*
  99990701-800, .*
  99990801-900, .*
  99990901-1000, .*

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:22:39 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Hinweis:

Wird ein Auftrag ausgewählt, der zwischenzeitlich oppositionsbelegte Stückenummern enthält, zeigt CASCADE diese mit dem Oppositionsgrund im Feld Mangel 1 hell erleuchtet an. Zusätzlich wird bei einem Online Druck die Anzahl der vorkommenden Oppositionen, die in der Hinweiszeile auf der Basismaske buchungsrelevanter Auftragsdaten angegeben sind, ausgedruckt.

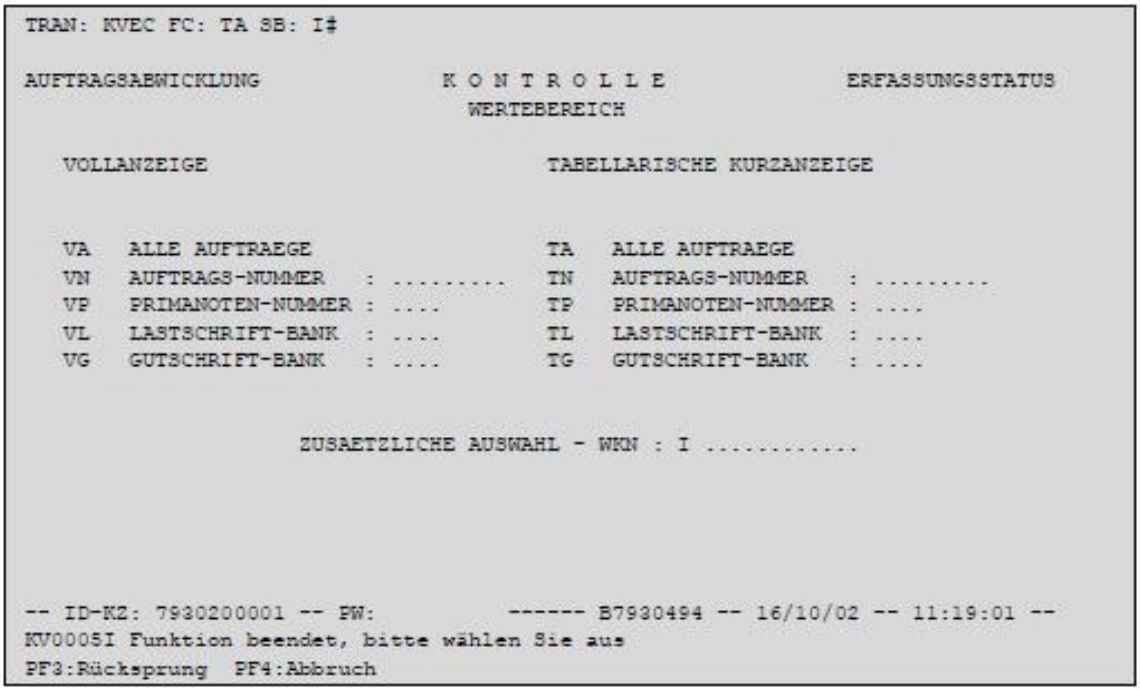
19 Kontrolle (EC)

Um die erfassten Aufträge verbindlich an die Clearstream Banking AG, Frankfurt zu erteilen, muss das Vier- Augen-Prinzip gewahrt werden, d. h. die vom Erfasser in das System eingegebenen Ein- und Auslieferungen werden von einer zweiten Person kontrolliert. Vom System wird sichergestellt, dass der Kontrolleur ein vom Erfasser abweichendes ID-KZ hat.

Die Kontrolle bietet für den Effektivbereich folgende Möglichkeiten:

- Kontrolle über Vollanzeige
- Kontrolle über Kurzanzeige

Im Rahmen der Zuordnung von Funktionen zu Transaktionen durch Ihren Security-Beauftragten wird die Art der Kontrolle von Aufträgen festgelegt.


TRAN: KVEC FC: TA SB: I#
AUFTRAGSABWICKLUNG
K O N T R O L L E
WERTEBEREICH
ERFASSUNGSSTATUS
VOLLANZEIGE
TABELLARISCHE KURZANZEIGE
VA ALLE AUFTRAEGE
VN AUFTRAGS-NUMMER : .....
VP PRIMANOTEN-NUMMER : ....
VL LASTSCHRIFT-BANK : ....
VG GUTSCHRIFT-BANK : ....
TA ALLE AUFTRAEGE
TN AUFTRAGS-NUMMER : .....
TP PRIMANOTEN-NUMMER : ....
TL LASTSCHRIFT-BANK : ....
TG GUTSCHRIFT-BANK : ....
ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : I .....
-- ID-KZ: 7930200001 -- PW: ------ B7930494 -- 16/10/02 -- 11:19:01 --
KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Zusätzliche Eingaben sind zu den folgenden Funktionscodes notwendig:

“VN”/“TN”= AUFTRAGS-NUMMER

“VP”/“TP”= PRIMANOTEN-NUMMER

“VL”/“TL” = LASTSCHRIFT-BANK

“VG”/“TG” = GUTSCHRIFT-BANK

Zusätzlich ist die Eingabe einer WKN/ISIN bei allen Funktionscodes erlaubt und bewirkt die Einschränkung der zu bearbeitenden Aufträge auf eine bestimmte Gattung.

19.1 Kontrolle über die Vollanzeige

(A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes 'EC' in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über Vollanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) hintereinander mit allen gespeicherten Daten angezeigt werden. So hat er die Möglichkeit, alle Daten eines Auftrages zu überprüfen. Erst auf der letzten Seite eines Auftrages erscheint das Feld für das Kontrollkennzeichen.

Die verschiedenen Funktionscodes für die Vollanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

Hinweis:

Ein kontrollierter Einlieferungsauftrag wird mit dem Übergang in den Auftragsstatus automatisch für die Disposition und Buchung bei der Clearstream Banking AG, Frankfurt gesperrt. Der Verwahrer gibt den Auftrag nach erfolgreicher Prüfung der Stücke frei.

Es können nur Einlieferungen kontrolliert werden, die vollständig erfasst sind.

In der Vollanzeige der Kontrolle wird bei oppositionsbelegten Stücken eine entsprechende Meldung für die im Auftrag enthaltenen Oppositionsstücke ausgegeben. Die Kontrolle eines Auftrages, in dem Oppositions- Stücke enthalten sind, ist nicht möglich.

Angabe der Primanoten-Nummer “0” bei Einstieg mit dem Funktionscode “VP” bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primanote zugeordnet sind.

Innerhalb eines Auftrages, der über mehrere Seiten geht, bewegt sich der Kontrolleur mit PF8 vorwärts bzw. mit PF7 rückwärts. Wenn er auf der letzten Seite das Kontrollkennzeichen setzt, drückt er PF3 zur Verarbeitung.

Es folgt die erste Seite des nächsten zu kontrollierenden Auftrages.

(B) Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages (VG)

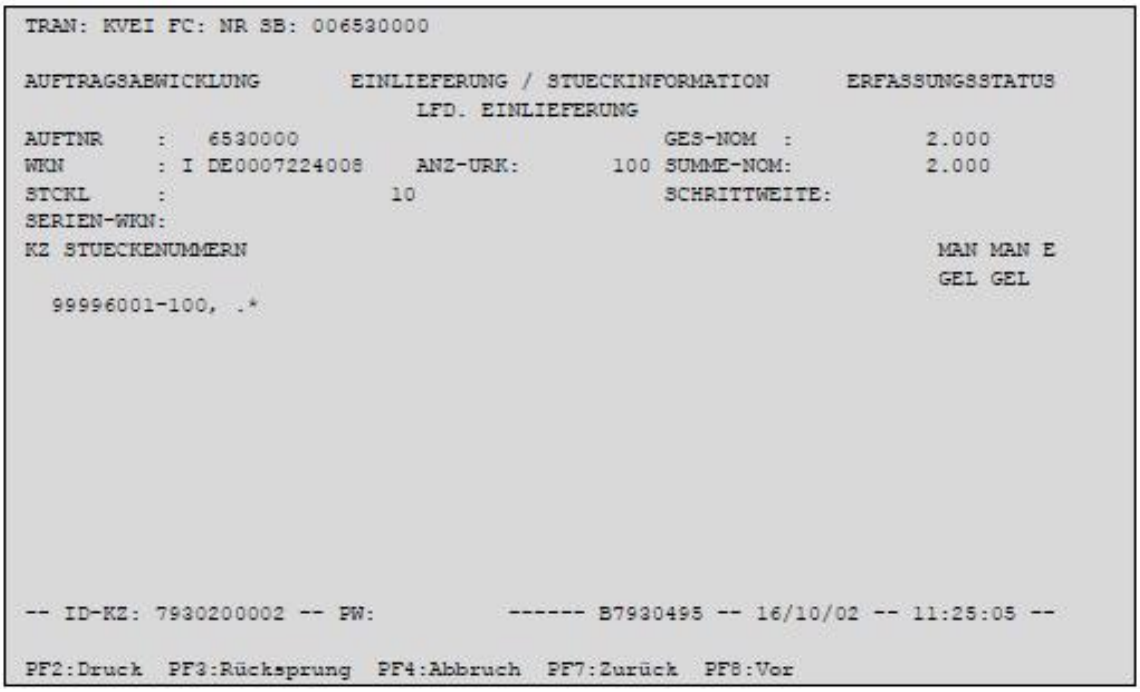
(B1) Beispielmaske für lfd. Einlieferung (gilt entsprechend für alle Auftragsarten)

```
TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE:  653           AUFTNR:   6530000       HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0007224008 SEDLMAYR S.-FR.KGAAO.N.

NOMINALE :          2.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          2.000          EINLIEF-ART  : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                                   EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ       :     -                 -                   KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT:

BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST


-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:24:35 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Folgemaske 1:

```
TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG        EINLIEFERUNG / FOLGEINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR:   6530000                                 WKN:  I DE0007224008
                                                  HLG: 01 GS

VERWAHR-MOEGLICHKEIT    :   9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG :   0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :       16                LETZT. KUPON  :         20

UEBERF KUPON        VON :                         BIS           :

NACHWEISART:   1 EINLIEF. EFF. URK.               SAMMELURKUNDE : N (J/N)



TEXT:

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:24:50 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Letzte Maske eines Einlieferungsauftrages:


TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000
AUFTRAGSABWICKLUNG EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION ERFASSUNGSSTATUS
LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR : 6530000 GES-NOM : 2.000
WKN : I DE0007224008 ANZ-URK: 100 SUMME-NOM: 2.000
STCKL : 10 SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN MAN MAN E
GEL GEL
99996001-100, .*
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:25:05 --
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"K" - Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an die CBF übergeben.

"F" - Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.

" " - Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

(C) Feldeingabemöglichkeiten und Abhängigkeitsprüfungen

Im Feld "Kontrollkennzeichen" (KZ) wird der Bearbeitungszustand des Auftrages angezeigt.

Sonderfall:

Ein von der CBF-Prüfstelle zurückgegebener Auftrag, kann nicht direkt gelöscht werden, sondern muss geändert und kontrolliert werden. Sind die Urkunden durch CBF zurückgegeben worden, kann der Auftrag zur Löschung generiert werden.

Mögliche Bearbeitungsstatus:

" " - nicht kontrollierter Auftrag

"F" - fehlerhafter Auftrag

"A " - aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag

"L" - aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

Einziges eingabefähiges Feld auf der letzten Seite eines Auftrages ist das Kontrollkennzeichen.

Nach PF3 wird die erste Seite des nächsten Auftrages mit einer Verarbeitungsbestätigung für den vorherigen Auftrag angezeigt.

19.2 Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige

(A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes "EC" in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über tabellarische Kurzanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) in tabellarischer Form angezeigt werden. Diese Form der Kontrolle ist angebracht, wenn die buchungsrelevanten Daten der Aufträge für die Kontrolle ausreichen. Auf einer Seite der tabellarischen Kurzanzeige können die Aufträge dann entweder als Einzel- oder Blockkontrolle freigegeben werden.

Die verschiedenen Funktionscodes für die tabellarische Kurzanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

Hinweis:

Die Angabe der Primanoten-Nummer "0" bei Einstieg mit dem Funktionscode "P" bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primanote zugeordnet sind.

In der tabellarischen Kurzanzeige werden die selektierten Aufträge sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung zur Verfügung gestellt.

(B) Tabellarische Anzeige der zu kontrollierenden Aufträge

```
TRAN: KVEC FC: TA SB: I$

AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / KONTROLLE           ERFASSUNGSSTATUS

                                                                        SEITE   1

KZ PRIM  AUFTR-NR LAST-KTO GUT-KTO  WKN                  NOMINALE

      0     21062 7960 217 7930 000 DE0008400003            1.012
      0     21064 7960 217 7930 000 DE0008400003               20
_     0     21065 7960 217 7930 000 DE0008400003                1
      0     21061 7960 217 7930 000 DE0008400003               11
      0     21063 7960 217 7930 000 DE0008400003              448
F   653   6530001 7960 000 7930 000 DE0007224008        1.000.000
L   653   6530000 7960 000 7930 000 DE0007224008            2.000
A   653    650001 7961 000 7930 000 DE0007616765          100.000
A   653    650002 7961 000 7930 000 DE0007616773          100.000


KONTROLLKENNZEICHEN:

-- ID-KZ: 7930200001 -- PW:          ------ B7930494 -- 16/10/02 -- 11:25:36 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Hinweis:

Im Feld "Kontrollkennzeichen" (KZ) wird der Bearbeitungsstatus des Auftrages angezeigt.

Mögliche Ausprägungen:

" " - nicht kontrollierter Auftrag

"F" - fehlerhafter Auftrag

"A " - aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag

"L" - aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

19.2.1 Kontrollvorgänge

Die angezeigten Aufträge können nun einzeln (Kennzeichen vor jedem einzelnen Auftrag) oder als Block (Kontrollkennzeichen am Ende der Tabelle) kontrolliert werden. Der Kontrolleur kann beide Möglichkeiten mischen, d. h. er kann eine Seite als Block und die nächste Seite mit Einzelkontrollen bearbeiten.

(A) Feldeingabemöglichkeiten und Abhängigkeitsprüfungen

Eingabefähige Felder auf dieser Maske sind die Kontrollkennzeichen am Anfang jeder Zeile der Tabelle (für die Einzelkontrolle) sowie das Kontrollkennzeichen unterhalb der Tabelle (für die Blockkontrolle). Folgende Eingaben im Feld Kontrollkennzeichen (KZ) in der ersten Spalte sind möglich:

Eingebbare Kontrollkennzeichen:

"K" - Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an die CBF übergeben.

"I" - Vollanzeige eines einzelnen Auftrages zur Information

"F" - Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.

" " - Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur ein "I" eingeben. Außerdem darf "I" nicht mit anderen Eingaben kombiniert werden, z. B. mit einem "F" in einer Zeile oder einem "K" im Kennzeichen Gesamtkontrolle. Es ist jedoch möglich, ein "I" einzugeben, wenn beim ersten Einstieg in die tabellarische Anzeige ein bereits als fehlerhaft gekennzeichneter Auftrag mit "F" erscheint und somit überschrieben wird.

Jedoch können mehrere Aufträge der Tabelle mit "F" bzw. "K" gekennzeichnet werden, d. h. diese beiden Eingaben sind miteinander kombinierbar.

Werden in den einzelnen Zeilen Aufträge mit "K" gekennzeichnet, darf das Kennzeichen Gesamtkontrolle nicht gesetzt werden.

Einzige Eingabemöglichkeit für das Kennzeichen Gesamtkontrolle ist "K" für Kontrolle aller Aufträge dieser Seite. Einzelne Aufträge kann man von dieser Kontrolle ausnehmen, indem man sie in der Zeile mit "F" kennzeichnet.

Eingebbares Kontrollkennzeichen bei Blockkontrolle:

"K" - Alle Aufträge dieser Seite (mit Ausnahme der mit "F" gekennzeichneten) sind damit kontrolliert und werden nach PF3 verbindlich an die CBF übergeben.

Kombination Einzelkontrolle/Blockkontrolle:

In bestimmten Fällen können sowohl in den Zeilenkennzeichen als auch im Kennzeichen Blockkontrolle Eingaben gemacht werden.

Will der Benutzer auf einer Seite nur einen Posten kontrollieren, dann setzt er vor dem gewünschten Auftrag ein "K".

Will er auf einer Seite einen Posten als fehlerhaft kennzeichnen, während alle anderen Posten kontrolliert werden sollen, setzt er vor dem fehlerhaften Auftrag ein "F" und in das Kontrollkennzeichen unter der Tabelle ein "K".

Soll auf einer Seite ein Auftrag als unkontrolliert stehen bleiben, während alle anderen Aufträge kontrolliert werden können, so muss er vor jedem kontrollierten Auftrag ein "K" setzen, während das Kontrollkennzeichen des unkontrollierten Auftrages leer bleibt.

Nach PF3 blättert das System auf die nächste Seite der tabellarischen Anzeige mit weiteren zu kontrollierenden Aufträgen. Auf dieser Seite wird die Verarbeitung der vorherigen Seite bestätigt. Wenn PF3 auf der letzten Seite gedrückt wird, kehrt das System zum Menü der Kontrolle zurück und gibt ebenfalls eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Jeder mit "F" gekennzeichnete Auftrag bleibt im Erfassungsstatus stehen und muss vom Erfasser mit dem Vorgang "Änderung im Erfassungsstatus (EB)" berichtigt werden. Alle kontrollierten Aufträge werden verbindlich an die CBF übergeben.

Ein von der CBF-Prüfstelle zurück gestellter Auftrag kann nicht direkt wieder kontrolliert werden. Dies kann erst nach Durchführung einer Änderung ausgeführt werden.

Nach erfolgter Kontrolle geht der Auftrag vom Erfassungs- in den Auftragsstatus über.

19.3 Automatische Löschung von Einlieferungsaufträgen im Erfassungsstatus

Alle Aufträge im Erfassungsstatus werden automatisch nach zehn Bankarbeitstagen gelöscht.

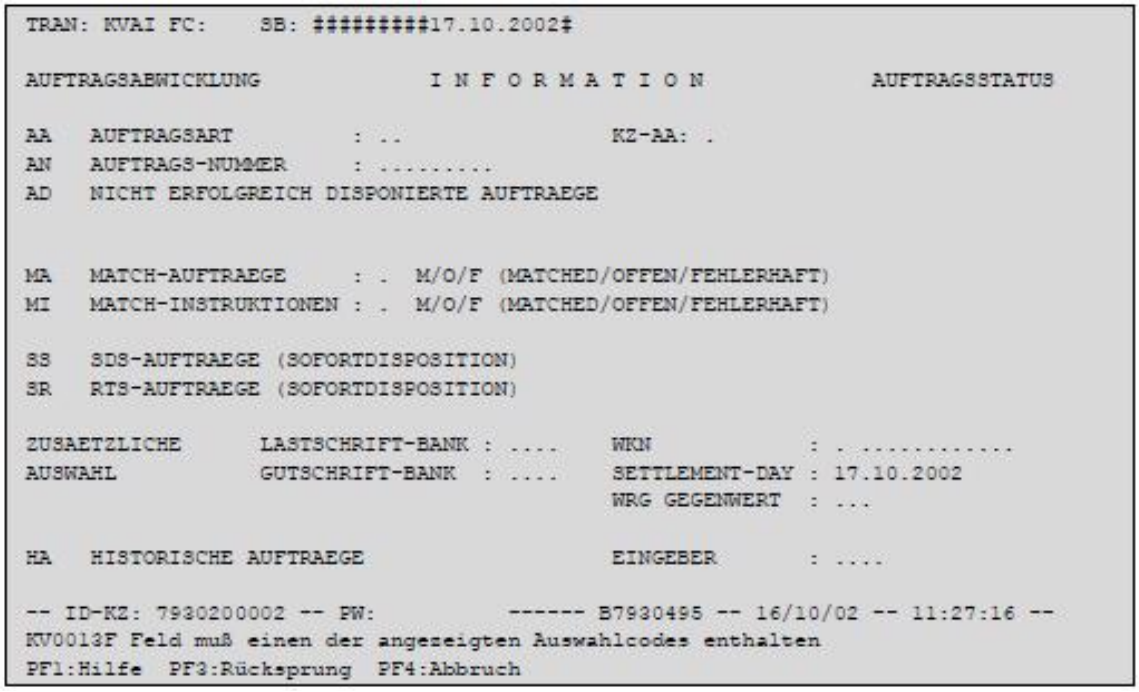
20 Information (AI)

Im Informationsdienst für die im CASCADE-Auftragsstatus[1] befindlichen Aufträge können Sie sich über Aufträge informieren,

- die Sie selbst in den CASCADE-Auftragsstatus eingestellt haben sowie

Die Informationsabfrage bietet darüber hinaus folgende Möglichkeiten:

- Kurzanzeige von Aufträgen aufgrund der angegebenen Auswahlkriterien,
- Vollanzeige eines Auftrages mit ausführlicher Statusanzeige für Bearbeitung und Disposition,
- Online-Druck eines Auftrages mit allen Informationen,
- Online-Druck des vollständigen Einlieferungsbeleges in der Kurzanzeige.zur Ablieferung bei CBF.


TRAN: KVAI FC: SB: #########17.10.2002#
AUFTRAGSABWICKLUNG I N F O R M A T I O N AUFTRAGSSTATUS
AA AUFTRAGSART : .. KZ-AA: .
AN AUFTRAGS-NUMMER : ....
AD NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE
MA MATCH-AUFTRAEGE : . M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
MI MATCH-INSTRUKTIONEN : . M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
SS SDS-AUFTRAEGE (SOFORTDISPOSITION)
SR RTS-AUFTRAEGE (SOFORTDISPOSITION)
ZUSAETZLICHE AUSWAHL
LASTSCHRIFT-BANK : ....
GUTSCHRIFT-BANK : ....
WKN : . .....
SETTLEMENT-DAY : 17.10.2002
WRG GEGENWERT : ...
HA HISTORISCHE AUFTRAEGE
EINGEBER : ....
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:27:16 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF1:Hilfe PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Es ist zu unterscheiden zwischen aktuellen und historischen Aufträgen:

1. Siehe auch CASCADE Handbuch, Band 1, z.B. Abschnitt 1.1.1 .

20.1 Aktuelle Aufträge (AA, AN, AD, SR)

Aktuelle Aufträge sind gültig an die CBF erteilte Aufträge im Auftragsstatus.

Folgende Funktionen (FC) stehen zur Verfügung:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AA	alle Aufträge einer Auftragsart (nach PF1 werden die möglichen Auftragsarten angezeigt).	*wenn AA = 16* [a] Gut-Bank = Mussfeld (Kundenkonto) Last-Bank = Kannfeld (internes Tresorkonto CBF) WKN/ISIN (optional) zusätzliche Auswahl möglich KZ AA: 16 L = Laufende Einlieferung N = Neuzulassung V = Valutierung *wenn AA = 18* [a] Last-Bank = Mussfeld (Kundenkonto) Gut-Bank = Mussfeld (internes Tresorkonto CBF) WKN/ISIN (optional) zusätzliche Auswahl möglich KZ AA: = 18 A = Laufende Auslieferung R = Auslieferung Rahmenurkunde S = Auslieferung Stückelose Werte

a. Das Gegenkonto entspricht jeweils einem internen Abwicklungskonto bei der CBF.

Zur Eingabe des zweistelligen Kürzels der Auftragsart bei dem Funktionscode AA kann der Benutzer die PF1-Taste drücken. Ihm werden dann zwei Masken mit den möglichen Auftragsarten, getrennt nach Giro- und Wertebereich, angezeigt:

(A) Hilfemaske zur Funktion AA

```
TRAN: KVAI FC:    SB: #########12.11.2008#

AUFTRAGSABWICKLUNG         ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

           ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --GIROBEREICH--

  01  WP-UEBERTRAG                          04  VERPFAENDUNG
      KZ-AA = A - CCP-AUFTRAG                05  FREIGABE
            = C - XEMAC-AUFTRAG              07  GBC-UMTAUSCH
            = E - EMISSIONSEINF. RS          09  GBC-RUECKTAUSCH
            = P - DEPOTUEBERTRAG RS          11  WP-LEIHAUFTRAG
            = B - BESTANDSUEBERTRAG RS       12  WP-LEIHE/RUECKFUEHRUNG
                                             13  KADI NON-INCOME
  02  MATCH-INSTRUKTION                     14  BOND-STRIPPING:AUFTEILUNG
      KZ-AA = A - CCP-INSTRUKTION            15  BOND-STRIPPING:ZUSAMMENFUEHRUNG
            = E - EMISSIONSEINF. RS          17  OPTIONSSCHEINTRENNUNG
                                             19  OPTIONSSCHEINZUSAMMENFUEHRUNG
  03  BWV/LSV-UEBERTRAG                     99  STORNO/NACHBUCHUNG DEPOTUMSATZ



-- ID-KZ: 7907232003 -- PW:          ------ B7907496 -- 12/11/08 -- 09:10:30 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

(B) Hilfemaske zur Funktion AA - Folgemaske Wertebereich:

```
TRAN: KVAI FC:    SB: #########12.11.2008#

AUFTRAGSABWICKLUNG         ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

              ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
  16  EINLIEFERUNG
      KZ-AA    EINLIEF-ART
        L          1       LFD. EINLIEFERUNG
        N          2       NEUZULASSUNG GLOBALURKUNDE
        N          3       NEUZULASSUNG RAHMENURKUNDE
        N          4       NEUZULASSUNG VALUTIERTE RAHMENURKUNDE
        V          5       VALUTIERUNG
        F          1       EINLIEFERUNG EINZELURKUNDE FREMDTRESOR
        F          2       EINLIEFERUNG GLOBALURKUNDE FREMDTRESOR
  16  EINLIEFERUNG (EDT)
      KZ-AA
        E          2       NEUZULASSUNG GLOBALURKUNDE EDT
        E          3       NEUZULASSUNG RAHMENURKUNDE EDT
        E          4       NEUZULASSUNG VALUTIERTE RAHMENURKUNDE EDT


-- ID-KZ: 7907232003 -- PW:          ------ B7907496 -- 12/11/08 -- 09:10:51 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAI FC:    SB: #########12.11.2008#

 AUFTRAGSABWICKLUNG         ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

                ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
   18  AUSLIEFERUNG
       KZ-AA
         A                  LFD. AUSLIEFERUNG
         R                  REVALUTIERUNG
         S                  TEILREDUZIERUNG
         F                  AUSLIEFERUNG FREMDTRESOR









 -- ID-KZ: 7907232003 -- PW:          ------ B7907496 -- 12/11/08 -- 09:11:39 --

 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

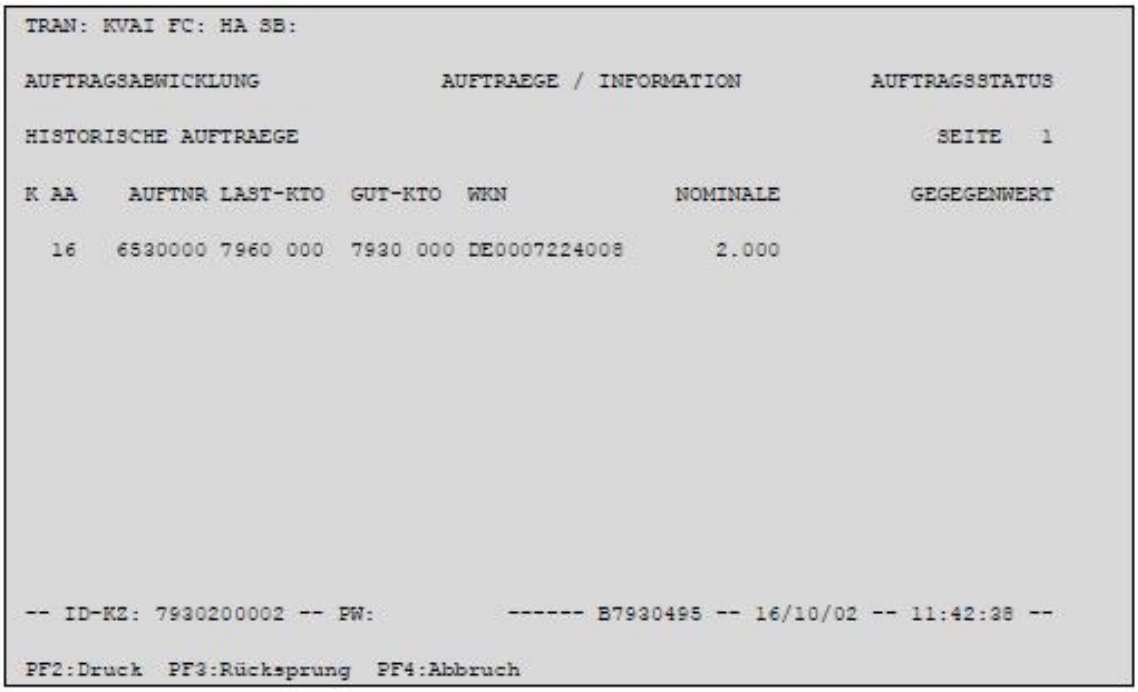
Folgende weitere Funktionen stehen zur Verfügung:

Nachfolgende weitere Funktionen können für Aufträge des Wertebereichs Bank aus dem Auswahlmenü *Information CASCADE-Auftragsstatus* genutzt werden.

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AN	Einzelauftrag mit der eingegebenen Auftragsnummer. Es können nur eigene Aufträge aufgerufen werden.	entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein SETTLEMENT-DAY (optional) WKN/ISIN (optional))
AD	alle nicht disponierten Aufträge	entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein WKN/ISIN (optional)
SR	alle RTS- (Real-Time-Settlement-) Aufträge	entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein WKN/ISIN (optional) SETTLEMENT-DAY = Tagesdatum (wird vorbelegt)

20.2 Historische Aufträge (HA)

Soll ein aktueller Auftrag geändert oder gelöscht werden, so wird dieser im Auftragsstatus markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt. Dadurch wird der Auftrag im Auftragsstatus ungültig. Gleichzeitig wird er als historischer Auftrag in seinem vollen Umfang und mit allen Statusausprägungen, die er zum Zeitpunkt der Markierung hatte, abgelegt.


TRAN: KVAI FC: HA SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG AUFTRAEGE / INFORMATION AUFTRAGSSTATUS
HISTORISCHE AUFTRAEGE SEITE 1
K AA AUFTNR LAST-KTO GUT-KTO WKN NOMINALE GEGEGENWERT
16 6530000 7960 000 7930 000 DE0007224008 2.000
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:42:38 --
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Mögliche Funktion:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
HA	Anzeige aller historischen Aufträge, die am Tagesdatum abgelegt werden.	zusätzliche Eingaben sind nicht erlaubt.

Die historische Anzeige erfolgt über alle Auftragsarten.

20.3 Information über Vollanzeige

(A) Allgemeine Beschreibung

Aktuelle und historische Aufträge können auch als Vollanzeige aufgerufen werden. Über die Maske der tabellarischen Kurzanzeige kann in die Vollanzeige verzweigt werden. Diese Auswahl ist für alle Funktionscodes gleich. Hier werden alle selektierten Aufträge mit den buchungsrelevanten Feldern angezeigt. Es werden folgende Statusmeldungen je Auftrag ausgegeben:

- Bearbeitungsstatus ("S") und
- Dispositions-Status ("D")

Hinweis:

Unabhängig von der zeitlichen Erfassung und Kontrolle werden die Auslieferungs- bzw. Einlieferungsaufträge immer mit der Settlement-Art 'RTS' für Real-Time-Settlement angezeigt.

Für die Ausdrucke muss der Bildschirm dem Drucker leitungsbezogen zugeordnet sein.

(B) Tabellarische Maske aktueller Aufträge Einlieferung/Auslieferung

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 16##7960#I####

AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS

LAST-BANK: 7960                    WRG GEGENWERT:                      SEITE   1

K M S D AA SA   AUFTNR GUT  WKN              NOMINALE           GEGENWERT SET-D

    1 1 16 5    700305 7930 DE0005151005       1.000                     30.09
    1 1 16 5     21163 7930 DE0006283302          21                     08.10
_   1 1 16 5       202 7930 DE0006283302       1.000                     10.09
    1 1 16 5   6530000 7930 DE0007224008       2.000                     16.10
_     4 16 5    559008 7930 DE0007277105     810.001                     16.09
    1 1 16 5     21070 7930 DE0008400003           1                     18.10
    1 1 16 5     21069 7930 DE0008400003           2                     18.10
_   1 1 16 5     21068 7930 DE0008400003          11                     18.10
    1 1 16 5     21066 7930 DE0008400003         200                     18.10
    1 1 16 5     21067 7930 DE0008400003      33.333                     18.10

GESAMTSUMMEN  ANZAHL AUFTRAEGE:     10       847.569

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:30:47 --
KV0043I Keine Währung für Gegenwert selektiert
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"S" = Druck des Einlieferungsbeleges (E-Beleg) für die CBF mit buchungs- und verwahrrelevanten Daten aber ohne Stückenummern nach Betätigung der Taste PF2 (siehe Der Einlieferungsauftrag auf Seite 22-1)

"D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur ein "I" eingeben. Außerdem darf "I" nicht mit der Eingabe eines "D" kombiniert werden.

Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen "D" ist zulässig.

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit "I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

(D) Beispiel Vollanzeige aktueller Auftrag Einlieferung

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 16##7960#I####

AUFTRAGSABWICKLUNG       EINLIEFERUNG / INFORMATION            AUFTRAGSSTATUS
                              LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR    :   6530000    HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0007224008 SEDLMAYR S.-FR.KGAAO.N.

NOMINALE :          2.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          2.000          EINLIEF-ART  : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                                   EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ       :     -                -                    KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT:
EING-NR:
BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST
DISPO-STATUS: 1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:33:01 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Im Auftragsstatus werden zusätzliche Informationen bezüglich Bearbeitungs-und Dispositionsstatus eines Auftrages angezeigt.

Leerseite

21 Änderung/Löschung (AA)

21.1 Markierung zur Änderung (MA)

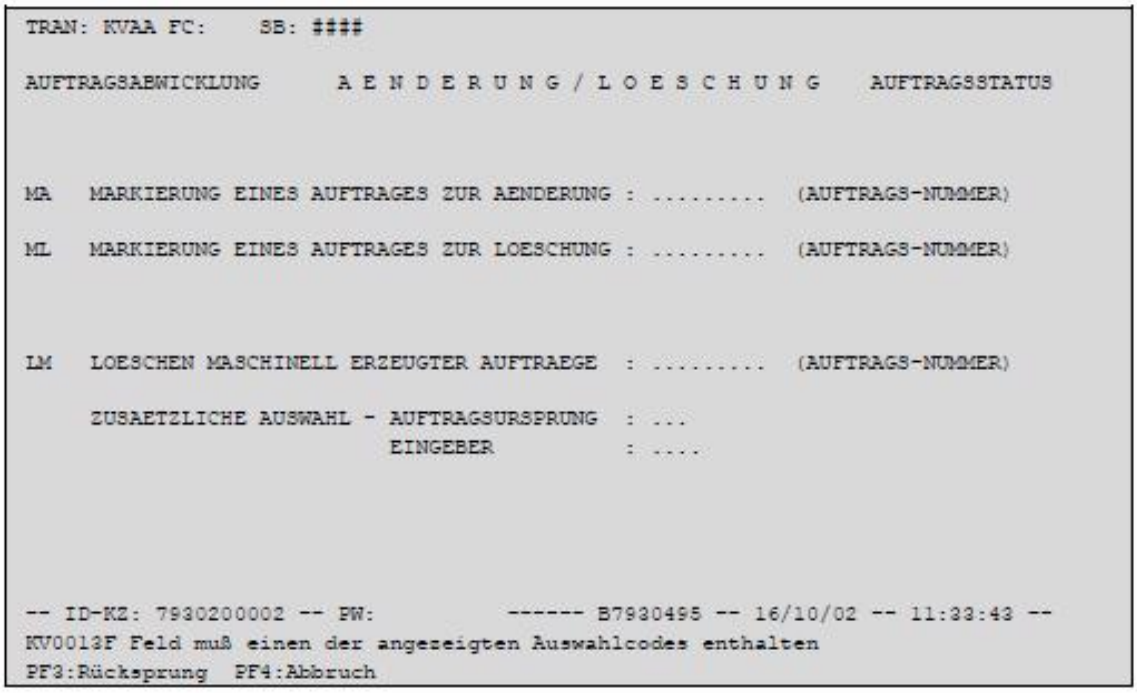
(A) Allgemeine Beschreibung

Ein- und Auslieferungsaufträge, die sich bereits im CASCADE-Auftragsstatus befinden, können unter bestimmten Voraussetzungen noch geändert werden. Einlieferungen können bis zum Bearbeitungsstatus "Annahme bei CBF erfolgt" zur Änderung bzw. Löschung durch den Eingeber bearbeitet werden. Auslieferungen sind bis zur Buchung durch den Eingeber zur Änderung bzw. Löschung bearbeitbar.

Änderungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus des Benutzers überführt.* Dieses Verfahren ist notwendig, um auch für Änderungen im Auftragsstatus das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen. Folgende Schritte laufen dabei ab:

- Markierung des zu ändernden Auftrages im Auftragsstatus
- Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
- Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
- Änderung des generierten Auftrages im Erfassungsstatus
- Kontrolle des geänderten Auftrages im Erfassungsstatus
- Übergang des geänderten Auftrages aus dem Erfassungsstatus in den Auftragsstatus als Neuauftrag

Mit der Eingabe der Funktion "AA" erscheint folgende Auswahlmaske:


TRAN: KVAA FC: SB: ####
AUFTRAGSABWICKLUNG A E N D E R U N G / L O E S C H U N G AUFTRAGSSTATUS
MA MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
ML MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LM LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
ZUSAETZLICHE AUSWAHL - AUFTRAGSURSPRUNG : ...
EINGEBER : ....
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:33:43 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Folgende Funktionen (FC) sind möglich:

MA = Markierung eines Auftrages zur Änderung über die Auftragsnummer

ML = Markierung eines Auftrages zur Löschung über die Auftragsnummer

Die Funktion "LM" kann nur von der CBF genutzt werden

Um einen Auftrag zur Änderung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode "MA" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

(B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Änderung

Beispielmaske für Einlieferung

```
TRAN: KVAA FC: MA SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / MARKIERUNG          AUFTRAGSSTATUS

LAST-KTO: 7960 000                                                SEITE   1


K M S D AA SA   AUFTNR GUT  WKN             NOMINALE           GEGENWERT SET-D

      1 16 5   6530000 7930 DE0007224008       2.000                   16.10









-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:34:17 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" - Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

"X" - Markierung des Auftrages zur Änderung

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann im Feld Kennzeichen also entweder ein "I" oder ein "X" eingegeben werden.

(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein "I" eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

(E) Markierung zur Änderung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem "X" zur Änderung markiert. Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus. Der markierte Auftrag wird mit dem internen Status 'Auftrag zur Änderung markiert, nicht mehr zur Verarbeitung heranziehen' versehen. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar. Anschließend wird der markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingebers generiert. Dort kann er dann geändert werden. Nach erfolgter Kontrolle wird er als Neuauftrag in den CASCADE-Auftragsstatus übernommen.

21.2 Markierung zur Löschung (ML)

(A) Allgemeine Beschreibung

Ein- und Auslieferungsaufträge, die sich bereits im CASCADE-Auftragsstatus befinden, können unter bestimmten Voraussetzungen gelöscht werden. Einlieferungen können bis zum Bearbeitungsstatus "Annahme bei CBF erfolgt" zur Löschung durch den Eingeber bearbeitet werden. Auslieferungen sind bis zur Buchung durch den Eingeber zur Löschung bearbeitbar.

Löschungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus des Benutzers überführt.* Dieses Verfahren ist notwendig, um das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen.

Folgende Schritte laufen dabei ab:

- Markierung des zu löschenden Auftrages im Auftragsstatus
- Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
- Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
- Kontrolle des zu löschenden Auftrages im Erfassungsstatus
- Physische Löschung des kontrollierten Auftrages aus dem Erfassungsstatus

Mit der Eingabe der Funktion "AA" erscheint folgende Auswahlmaske:

```
TRAN: KVAA FC:     SB: ####

AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G    AUFTRAGSSTATUS


MA   MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)

ML   MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)


LM   LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE  : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)

     ZUSAETZLICHE AUSWAHL - AUFTRAGSURSPRUNG  : ...
                            EINGEBER          : ....




-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:35:07 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Folgende Funktionen (FC) sind möglich:

MA = Markierung eines Auftrages zur Änderung über die Auftragsnummer

ML = Markierung eines Auftrages zur Löschung über die Auftragsnummer

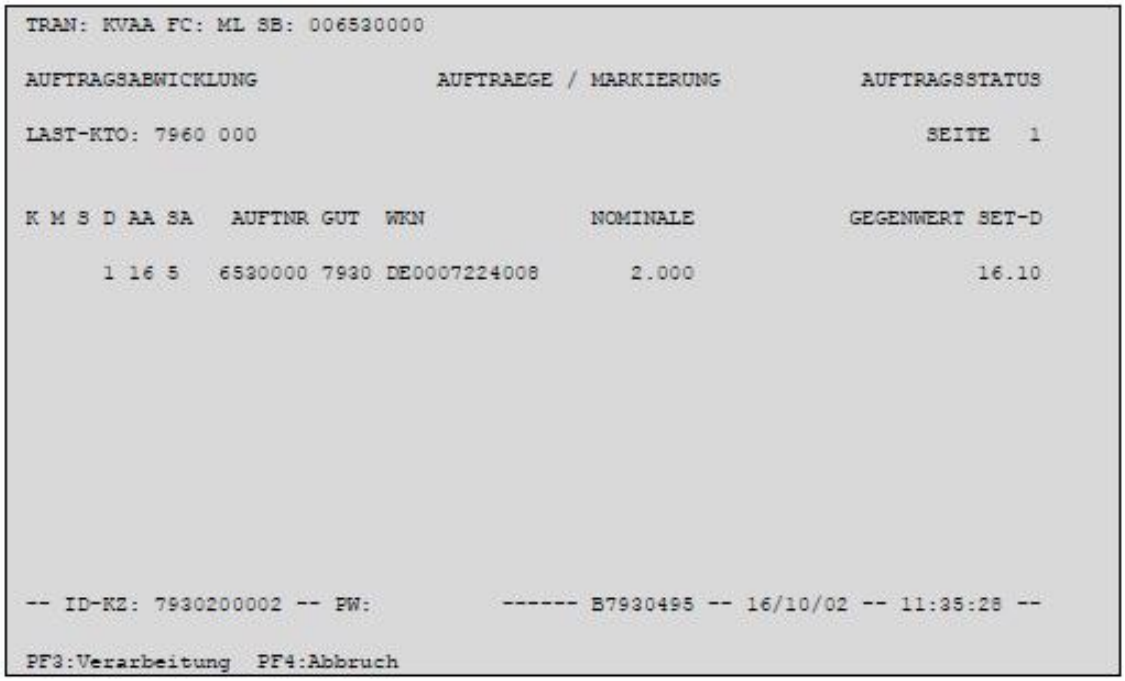
Die Funktion "LM" kann nur von der CBF genutzt werden

Um einen Auftrag zur Löschung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode 'ML' sowie der

Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

(B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Löschung

Beispielmaske Einlieferung:


TRAN: KVAA FC: ML SB: 006530000
AUFTRAGSABWICKLUNG AUFTRAEGE / MARKIERUNG AUFTRAGSSTATUS
LAST-KTO: 7960 000 SEITE 1
K M S D AA SA AUFTNR GUT WKN NOMINALE GEGENWERT SET-D
1 16 5 6530000 7930 DE0007224008 2.000 16.10
-- ID-KZ: 7930200002 -- PW: ------ B7930495 -- 16/10/02 -- 11:35:28 --
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" - Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

"X" - Markierung des Auftrages zur Löschung

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann im Feld Kennzeichen nur ein "I" oder ein "X" eingegeben werden.

(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein "I" eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht und der Benutzer sich vergewissern will, dass er den richtigen Auftrag bearbeitet. Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

(E) Markierung zur Löschung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem "X" zur Löschung markiert. Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus. Der markierte Auftrag wird mit dem internen Status 'Auftrag zur Löschung markiert, nicht mehr zur Verarbeitung heranziehen' versehen. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar. Anschließend wird der markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingebers generiert. Dort läuft dieser Auftrag dann direkt in die Kontrolle. Nach erfolgter Kontrolle wird dieser Auftrag physisch aus dem Erfassungsstatus gelöscht.

21.3 Autom. Löschung von Einlieferungsaufträgen zu denen keine Stücke eingeliefert wurden

In der bisherigen Verarbeitung werden Einlieferungsaufträge, die erfasst, kontrolliert aber noch nicht von CBF angenommen wurden, ungeachtet ihres Erfassungsdatums täglich vorgetragen.

Einlieferungsaufträge werden im CASCADE-Auftragsstatus im Laufe der buchungstäglichen RTS-Ende-Verarbeitung auf Fristüberschreitung geprüft. Abhängig vom Ergebnis der Prüfung werden sie entweder vorgetragen, gemahnt oder gelöscht. Die Mahnung oder Löschung wird auf der entsprechenden CASCADE-Warnliste dokumentiert.

Ausgenommen von der Prüfung sind Aufträge in Namensaktien (RS).

21.3.1 Systeminformationen zu Fristen (KVAV)

Für Einlieferungsaufträge werden drei Fristen definiert, die von den schon für die anderen Auftragsarten geltenden Werten abweichen (können):

- 1. Mahnungsfrist 65 Tage
- 2. Mahnungsfrist 85 Tage
- Löschung nach 90 Tage

21.3.2 Online-Information zu den gültigen Fristen (IS)

Diese Fristen können online über die Transaktion “KVAV” Funktion: “IS” eingesehen werden.

```
TRAN: KVAV FC: IS SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG            SYSTEM-INFORMATIONEN          VEROEFFENTLICHUNGEN

AUFTRAEGE VERBLEIBEN  2 BANKARBEITSTAGE IM ERFASSUNGSSTATUS, BEVOR SIE
GELOESCHT WERDEN.
ES WERDEN NUR AUFTRAEGE ENTGEGENGENOMMEN, DEREN SETTLEMENT-DAY NICHT MEHR ALS
40 BANKARBEITSTAGE IM VORAUS LIEGT.

AUFTRAEGE IM AUFTRAGSSTATUS WERDEN HOECHSTENS 40 BANKARBEITSTAGE VORGETRAGEN.
DANN WERDEN SIE GELOESCHT :
EINE 1. WARNUNG ERFOLGT NACH 15 BANKARBEITSTAGEN,
EINE 2. WARNUNG ERFOLGT NACH 35 BANKARBEITSTAGEN.

EINLIEFERUNGEN IM AUFTRAGSSTATUS WERDEN HOECHSTENS 90 BANKARBEITSTAGE VORGE-
TRAGEN. DANN WERDEN SIE GELOESCHT :
EINE 1. WARNUNG ERFOLGT NACH 65 BANKARBEITSTAGEN,
EINE 2. WARNUNG ERFOLGT NACH 85 BANKARBEITSTAGEN.

ONLINE-ENDE FUER AUFTRAGSABWICKLUNG IST 19.00 UHR.

-- ID-KZ: 7907232003 -- PW:          ------ B7907496 -- 12/11/08 -- 09:18:18 --

PF3:Ruecksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAV FC: IS SB:

 AUFTRAGSABWICKLUNG            SYSTEM-INFORMATIONEN          VEROEFFENTLICHUNGEN

                                          A N N A H M E F R I S T
 VERARBEITUNGSLAUF                        DFUE         ONLINE
 ------------------------------------------------------------------------------
 STD (STANDARDVERARBEITUNG)               18.45        19.00
 REAL-TIME STANDARD                       05.15        05.30
 1. SDS (SAME DAY SETTLEMENT)             09.45        10.00
 2. SDS (SAME DAY SETTLEMENT)             13.00        13.15
 RTS MIT GEGENWERT EUR                    16.15        16.30
 RTS MIT GEGENWERT FREMDWAEHRUNG          16.45        17.00
 RTS OHNE GEGENWERT                       17.45        18.00
 MARKIERUNG SELBSTBESICHERUNG             17.45        18.00


 Verarbeitungsbedingt kann eine Verlängerung der Annahmefristen erfolgen.



 -- ID-KZ: 7907232003 -- PW:          ------ B7907496 -- 12/11/08 -- 09:18:51 --

 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAV FC: IS SB:

 AUFTRAGSABWICKLUNG            SYSTEM-INFORMATIONEN          VEROEFFENTLICHUNGEN

 FREMDWAEHRUNG-ABWICKLUNG
 ------------------------
 ONLINE-ENDE DER STUECKE-RESERVIERUNG BEI FREMDWAEHRUNG IST 17.00 UHR.


 CASCADE-RS (UMSCHREIBUNG, ERSTEINTRAGUNGEN + AKTIONAERSDATENAENDERUNGEN)
 ------------------------------------------------------------------------
 1. ZUWEISUNG RS-AUFTRAEGE                                        ca. 10.30
 2. ZUWEISUNG RS-AUFTRAEGE                                        ca. 13.30
 3. ZUWEISUNG RS-AUFTRAEGE                                        ca. 17.00
 WEITERLEITUNG RS-AUFTRAEGE AN AKTIENREGISTER AUS 1.-3. ZUWEISUNG  ca. 18.00







 -- ID-KZ: 7907232003 -- PW:          ------ B7907496 -- 12/11/08 -- 09:19:51 --

 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

In diesem Beispiel sind die entsprechenden Felder mit den oben genannten Fristen vorbelegt. Über KVAV AS können sie von CBF jederzeit geändert werden. Dabei wird sichergestellt, dass die Werte für die einzelnen Fristen sinnvoll sind und nicht die Löschfrist kleiner gewählt wird als eine der Warnfristen.

21.3.3 Prüfung auf Fristüberschreitung

Die Prüfung kann abhängig vom Settlement-Day des Auftrags zu folgenden Ergebnissen führen:

- Settlement-Day = Verarbeitungsdatum – 65 Bankarbeitstage

Der Auftrag wird vorgetragen und in der entsprechenden Warnliste für CASCADE-Aufträge als zum ersten Mal gemahnter Auftrag angedruckt und vorgetragen.

- Settlement-Day = Verarbeitungsdatum – 85 Bankarbeitstage

Der Auftrag wird vorgetragen und in der entsprechenden Warnliste für CASCADE-Aufträge als zum zweiten Mal gemahnter Auftrag angedruckt und vorgetragen.

- Settlement-Day = Verarbeitungsdatum – 90 Bankarbeitstage

Der Auftrag und alle zugehörigen Stücke werden gelöscht und in der entsprechenden Warnliste für CASCADE-Aufträge als gelöschter Auftrag angedruckt und vorgetragen. In allen anderen Fällen werden die Aufträge nur vorgetragen.

21.4 Automatische Löschung von Aufträgen bei Redenomination

Werden Gattungen in Euro umgestellt, werden alle offenen Ein- und Auslieferungen im Auftragsstatus automatisch gelöscht.

Leerseite

22 Belege

22.1 Der Einlieferungsauftrag

Die Geschäftsbedingungen der CBF sehen vor, dass zusätzlich zur Einlieferung der effektiven Urkunden ein Einlieferungsauftrag mitgeliefert werden muss.

Dieses Formular enthält die buchungs- und verwahrrelevanten Daten (ohne Stückenummern), wie sie im CASCADE-Einlieferungsauftrag erfasst wurden und zu dem Einlieferungsposten gehören. Bei Einlieferungen in Namensaktien (Registered Shares - RS) vor dem GS-Stichtag entfällt der Einlieferungsauftrag.

Den effektiven Urkunden muss dieser Einlieferungsauftrag als Beleg zweifach beigelegt werden. Die Erstellung des Beleges online kann über den Informationsdienst des CASCADE-Auftragsstatus erfolgen. Mit Aufruf des entsprechenden Auftrages, kann der Anwender durch Kennzeichen "S" in der Kurzanzeige und Betätigung der PF2-Taste den Ausdruck direkt anfordern. Voraussetzung hierzu ist die leitungsbezogene Zuordnung des Bildschirmes zum Drucker. Kunden, die Einlieferungsaufträge an die CBF aus ihren Inhouse-Systemen per Datenfern- Übertragung übermitteln, können den Einlieferungsauftrag auch über ihre eigenen DV-Anwendungen erstellen. Dieser Beleg muss inhaltlich mit dem CASCADE-Ausdruck identisch sein. Lediglich die Information zum Last-Konto kann entfallen.

```
TESTBANK AG                                              FRANKFURT, DEN 16.10.2002
EFFEKTENKASSE
ARABELLASTRASSE 12

D 81925 MUENCHEN



CLEARSTREAM BANKING AG
NEUE BOERSENSTRASSE 1
60487 FRANKFURT AM MAIN

                    E I N L I E F E R U N G S A U F T R A G        SEITE:  1
                              (VORBEHALTSQUITTUNG)


DIE CLEARSTREAM BANKING, FRANKFURT ERHAELT ANBEI
ZUR GUTSCHRIFT AUF SAMMELBESTANDSKONTO:

AUFTNR   :   6530000          HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000       TESTBANK AG
WKN      : I DE0007224006 SEDLMAYR S.-FR.KGAAO.N.

NOMINALE :          2.000          EINHEIT: ST    ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          2.000          EINLIEF-ART  : 1   LFD. EINLIEFERUNG
GRUNDEINHEIT:                      EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ       :     -                -                  KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON-NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT:
EING-NR:
BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST
DISPO-STATUS:   1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN

VERWAHR-MOEGLICHKEIT    :   9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG :   0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :       16                 LETZTER KUPON :         20
ANHAENGENDER TALON      :
UEBERF. KUPON        VON:                          BIS           :

NACHWEISART:   1 EINLIEF. EFF. URK.                SAMMELURKUNDE : N

TEXT:



STUECKELUNG:                 10      ANZ-URKUNDEN:       100
STUECKELUNG:                  1      ANZ-URKUNDEN:      1000

EMPFANGSBESTAETIGUNG UNTER VORBEHALT DER STUECKEPRUEFUNG
UND VOLLSTAENDIGKEIT DER ANGABEN.



     DATUM                          UNTERSCHRIFT
```

23 Auswertungen

Alle Auswertungen sind in Band 2 des Benutzerhandbuchs, Kapitel 6 (Reporting) detailliert beschrieben.

Auswertungen für die CASCADE-Anwendung gibt es bereits in Listform für

- den Erfassungsstatus und
- den Auftragsstatus.

Darüber hinaus existieren weitere Auswertungen wie

- die Avise,
- Listen aus der Disposition,
- Regulierungsliste/-datenträger und
- die Depottagesauszüge.

CASCADE-Aufträge, die den Effektivbereich betreffen, werden entweder in dieses Umfeld integriert oder entsprechend neu hinzugefügt.

Leerseite

24 Listen aus CASCADE

Die Ein- und Auslieferungsaufträge aus der abendlichen Buchung werden in zwei CASCADE-Tageslisten dokumentiert.

Die nicht kontrollierten Aufträge stehen in der Liste der nicht freigegebenen Aufträge. Die kontrollierten Aufträge finden sich in der Liste der an die CBF gültig erteilten Aufträge.

24.1 CASCADE-Tageslisten Erfassungsstatus

Speziell für die Auftragsarten im Wertebereich werden folgende ergänzende Listen erstellt:

- Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen (nachfolgend eine Beispielliste),
- Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits zehn Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen und somit gelöscht werden. Diese Liste ist inhaltlich identisch mit der Liste für Aufträge, die bereits fünf Bankarbeitstage im Erfassungsstatus stehen.
- Liste der Aufträge für Auslieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen (nachfolgend eine Beispielliste),
- Liste der Aufträge für Auslieferungen, die bereits zehn Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen und somit gelöscht werden. Diese Liste ist inhaltlich identisch mit der Liste für Aufträge, die bereits fünf Bankarbeitstage im Erfassungsstatus stehen.

24.1.1 Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen

```
CLEARSTREAM BANKING AG                                  FRANKFURT, DEN 23.10.2001
NEUE BOERSENSTRASSE 1                                   TELEFON      +49-69-50955-0
                                                        TELEFAX      +49-69-50955-3701

TESTBANK AG
DEPOTBUCHHALTUNG-ABWICKLUNG

POSTFACH 10 08 50
D 60008 FRANKFURT AM MAIN


BANK-NUMMER    : 7 513

VON CBF ZUM 1. MAL GEWARNTE AUFTRAEGE                          23.10.2001 SEITE :   1
LOESCHUNG ERFOLGT AM 25.10.2001 ABENDS

AUFTRAGSART 16   EINLIEFERUNG-NEU

PNOTE  AUFTR-NR LAST-KTO GUT-KTO  WKN             NOMINALE          SET-DAY
  999   1011209 7960 000 7930 000 DE0005151001      20.100          02.11.01
  999   1011210 7960 000 7930 000 DE0005151001      20.100          02.11.01
  999   1011211 7960 000 7930 000 DE0005151001      20.100          02.11.01

SUMMEN  EINLIEFERUNG-NEU
                  ANZAHL               NOMINALE              GEGENWERT
                       3                 60.300

SUMMEN  ALLER AUFTRAGSARTEN
                  ANZAHL               NOMINALE              GEGENWERT
                       3                 60.300
                       0                      0    - IN FREMDWAEHRUNG -
```

24.2 CASCADE-Tageslisten Auftragsstatus

Auslieferungsaufträge sind in nachfolgende Listen aus dem CASCADE-Auftragsstatus integriert

- Liste der nicht zur Disposition übernommenen Aufträge
- Liste der Aufträge, die 15 Tage nach Settlement-Day nicht disponiert werden konnten (erste Warnung) mit Statusmeldung
- Liste der Aufträge, die 35 Tage nach Settlement-Day nicht disponiert werden konnten (zweite Warnung) mit Statusmeldung
- Liste der Aufträge, die nach 40 Tagen gelöscht wurden
- Liste der historischen Aufträge

24.3 Erfassungs- und Auftragsstatus CASCADE

24.3.1 Oppositionsliste zu Einlieferungen

Die *Oppositionsliste* enthält alle teilweise bzw. vollständig erfassten Einlieferungsaufträge im Erfassungsstatus und/oder kontrollierte Aufträge im Auftragsstatus, die durch die täglichen Oppositionsprüfungen mit Opposition belegt wurden. Aufträge mit oppositionsbelegten Stückenummern, die bereits im Auftragsstatus stehen, werden in den Erfassungsstatus zurückgeneriert.

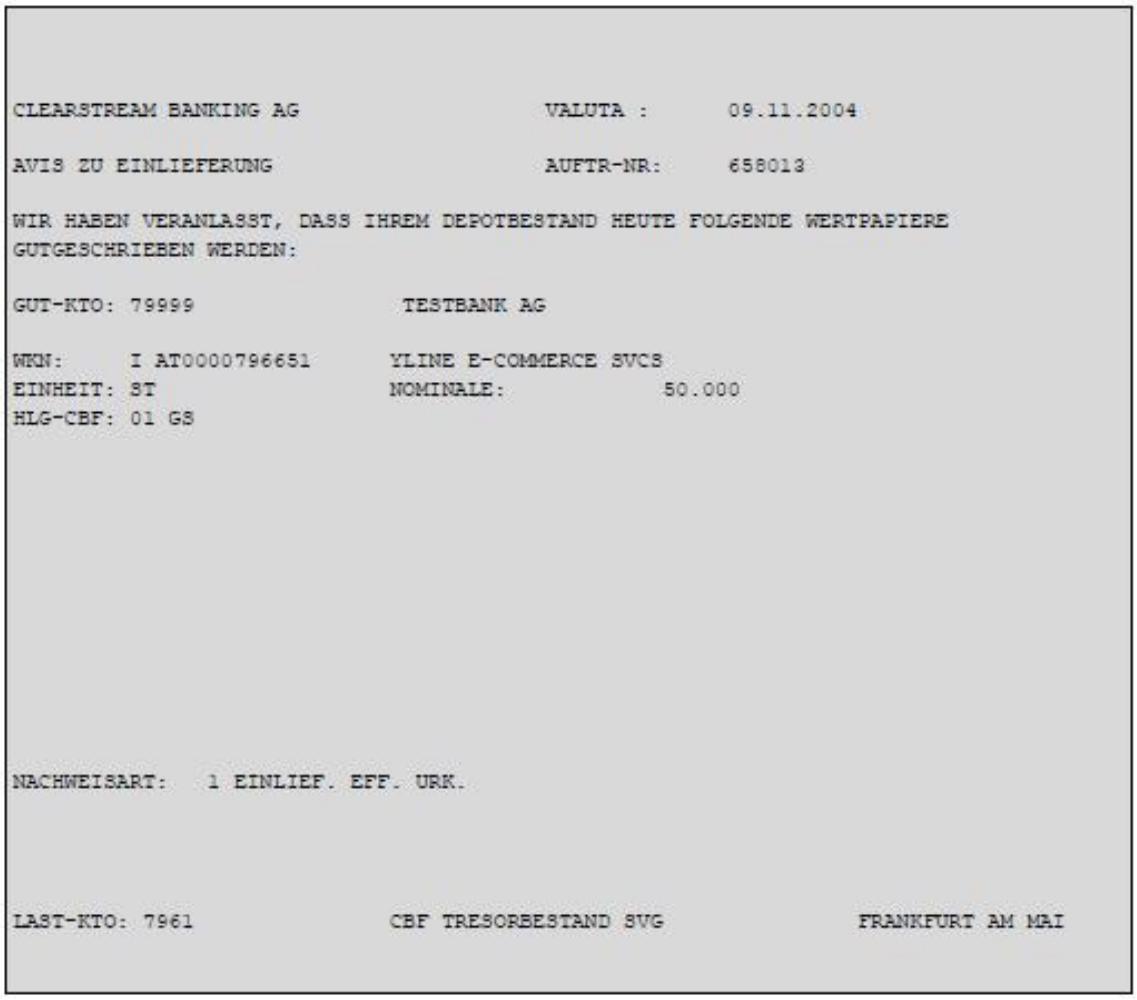
```
CLEARSTREAM BANKING AG                                FRANKFURT, DEN 23.11.2001
                                                       TELEFON      (069) 2101-0
BOERSENPLATZ 7 - 11                                    TELEFAX      (069) 2101-0
60313 FRANKFURT AM MAIN                                TELEX        413 773 WSBFM D

TESTBANK AG
HAUPTVERWALTUNG FRANKFURT/MAIN

POSTFACH 111111
D 66666 FRANKFURT AM MAIN

BANK-NUMMER   : 7 513

DIE NACHFOLGENDEN OFFENEN AUFTRAEGE FUER EFFEKTIVE                    SEITE : 1
EINLIEFERUNGEN WURDEN UEBER DIE ABENDLICHE OPPOSITIONSPRUEFUNG
ALS FEHLERHAFT ERKANNT:

AUFTRAGSART    16    EINLIEFERUNG


PRIM AUFTNR     GUT-KTO   WKN              NOMINALE       BEARBEITUNGSSTATUS
USER-ID     KUNDENREFERENZ
ERFASSER
STUECKELUNG    STUECKENUMMERN
OPPOSITIONSGRUND

962 2384000   7930 000     DE0002384005     2.000.000       50
7930000001  BIC-DE222222
10.000          10001
TOTALFÄLSCHUNG MÖGLICH

23 234567    7930 000      DE0004750153     1.500.000
7930000004  KTO-00303000 KTO-1234000000000          100
1.000           5000
ZAHLUNGSSPERRE

SUMMEN EINLIEFERUNGEN

ANZAHL      NOMINALE
     2     3.500.000

DIESE EINLIEFERUNGEN WURDEN NOCH NICHT KONTROLLIERT !!
```

24.4 Weitere Auswertungen für Einlieferungen

24.4.1 Avise

Die bereits existierenden Avise für Depotgutschriften enthalten für Einlieferungen zusätzlich folgende Informationen:

- HLG (Hinterlegungsart-CBF)
- Nachweisart



```
CLEARSTREAM BANKING AG                    VALUTA :      09.11.2004

AVIS ZU EINLIEFERUNG                      AUFTR-NR:     658013

WIR HABEN VERANLASST, DASS IHREM DEPOTBESTAND HEUTE FOLGENDE WERTPAPIERE
GUTGESCHRIEBEN WERDEN:

GUT-KTO: 79999                 TESTBANK AG

WKN:     I AT0000796651        YLINE E-COMMERCE SVCS
EINHEIT: ST                    NOMINALE:            50.000
HLG-CBF: 01 GS









NACHWEISART:   1 EINLIEF. EFF. URK.



LAST-KTO: 7961                 CBF TRESORBESTAND SVG              FRANKFURT AM MAI
```

24.5 Auswertungen für die Einlieferung von Namensaktien vor dem GS-Stichtag

Die Einlieferungen von Namensaktien sind in den Auswertungen, wie sie für die Auftragsart "laufende Einlieferung", Neuzulassung und Valutierung existieren, integriert.

Darüber hinaus wird zusätzlich eine Liste erstellt, die abgelehnte Aufträge aus der Prüfung gegen die Emittentendatei enthält.

24.6 List-Identifikation

Kunden der CBF können mit Hilfe der spezifischen Listidentifikation Listen in der von ihnen festlegten Priorität ausdrucken. Es sind hier nur die für den Wertebereich betroffenen Listen aufgeführt.

24.6.1 CASCADE-Auftragsabwicklung

CASCADE–Auftragsabwicklung	
Listbezeichnung	Merkmal
AN CBF ERTEILTE AUFTRAEGE	KV102001
AN CBF GUELTIG ERTEILTE AUFTRAEGE HIST.	KV102002
VON CBF GELOESCHTE AUFTRAEGE	KV102003
VOM EINGEBER GELOESCHTE AUFTRAEGE	KV102004
VOM KONTRAHENTEN GELOESCH. AUFTRAEGE	KV102005
BISHER OHNE FREIGABE AN CBF	KV102006
VON CBF ZUM 1. MAL GEWARNTE AUFTRAEGE	KV102007
VON CBF ZUM 2. MAL GEWARNTE AUFTRAEGE	KV102008
NICHT ZUR STD-MASSENDISPOSITION VALUTA TT.MM.JJJJ UEBERNOMMEN SDS-MASSENDISPOSITION RTS-MASSENDISPOSITION	KV156001
NICHT ZUR BUCHUNG VALUTA TT.MM.JJJJ UEBERNOMMEN	KV197930
AENDERUNGSHISTORIE AUFTRAEGE AUFTRAGSSTATUS	KV132001
LISTE DER NACH RTS-ENDE AUF DEM CBF-ZWISCHENKONTO VERBLIEBENEN UEBERWEISUNGEN	KV243001

24.6.2 CASCADE-Verarbeitung

CASCADE–Auftragsabwicklung	
Listbezeichnung	*Merkmal*
ZUSAMMENSTELLUNG ALLER DURCH KAPITALDIENSTE BETROFFENER GESCHAEFTE	KV259001
DIE NACHFOLGENDEN OFFENEN AUFTRAEGE FUER EFFEKTIVE EINLIEFERUNGEN WURDEN UEBER DIE ABENDLICHE OPPOSITIONSPRUEFUNG ALS FEHLERHAFT ERKANNT	KV271001
DEPOTTAGESAUSZÜGE	KV124001

24.6.3 CASCADE-Dienste für Namensaktien (RS)

CASCADE-RS-Abwicklung	
Listbezeichnung	*Merkmal*
FEHLERHAFTE EINLIEFERUNGSAUFTRAEGE IM ERFASSUNGS- BZW. AUFTRAGSSTATUS AUS PRUEFUNG GEGEN EMITTENTENDATEI	KG 100001 KG 100002

25 Depot-Disposition und Buchung

Für Informationen zur Wertpapierdisposition und -Buchung innerhalb des GS-Abwicklungssystems wird auf CASCADE Handbuch Band 1 (Kapitel 1) und Band 2 (Kapitel 1) des Benutzerhandbuchs sowie das CBF Kundenhandbuch verwiesen. Die nachfolgenden Abschnitte erläutern die Einbindung des Effektivbereiches in diese Abläufe.

25.1 Die Auftragsarten "Einlieferung" und "Auslieferung"

25.1.1 Gesamtablauf im zeitlichen Überblick

Nachfolgende Graphik verdeutlicht die zeitliche Abfolge für die Abwicklung der Einlieferungsaufträge bzw. Auslieferungsaufträge (laufende Einlieferung, Neuzulassung und Valutierung) von der Auftragserteilung, Prüfung und Freigabe bei der CBF bis zur Buchung.

Permanente Auftragserteilung/Auftragsverarbeitung in CASCADE

Start CASCADE Online	Beschreibung	Ende CASCADE Sofortdiaposition (RTS) „Valuta heute"	Ende CACADE Online	Start Standard-Disposition (STD) „Valuta heute per morgen"
06:00 Uhr	Freigabe von Einlieferungs-aufträgen durch die CBF für RTS-Buchung.	18:00 Uhr	19:00 Uhr	19:00 Uhr
06:00 Uhr	Freigabe von Auslieferungsaufträ gen durch Kunden der CBF und Prüfstelle CBF für RTS-Buchung.	18:00 Uhr	19:00 Uhr	19:00 Uhr

Ein- und Auslieferungsaufträge, die bis 17:30 Uhr von der CBF freigegeben sind und Settlement-Day gleicher Tag haben, werden gleichtägig in RTS/Cont (Sofortdisposition) verbucht.

Auslieferungsaufträge für Einzelurkunden, die bis 17:30 Uhr durch den Kunden mit dem entsprechenden Settlement-Tag eingestellt werden und von der CBF-Prüfstelle zur Buchung freigegeben werden, werden gleichtägig in RTS/Cont verbucht. Auslieferungsaufträge für Sammelurkunden werden erst nach der Freigabe zur Buchung via KPZS FA/KPST FA in RTS/Cont verbucht. Kann ein freigegebener Auftrag mangels Depotbestand, nicht gebucht werden, wird er im CASCADE-Auftragsstatus für die nächste Disposition und Buchung vorgetragen.

Ein- und Auslieferungsaufträge mit Settlement-Tag in der Zukunft können bereits vor Erreichen des Settlement-Tages zur Buchung freigegeben werden. Die Aufträge werden nach der Buchungsfreigabe mit einer Settlementsperre versehen und mit dem Erreichen des Settlement-Tages automatisch gebucht.

Hinweis: Kontensperren werden bereits mit der Freigabe zur Buchung geprüft, so dass im Falle einer Sperre keine Buchung möglich ist.

25.2 Rückgabe von Aufträgen

25.2.1 Rückgabe von Einlieferungen

Bei Rückgabe der effektiven Stücke durch die CBF an den Auftraggeber wird der zugehörige Auftrag automatisch in den CASCADE-Erfassungsstatus generiert und mit dem Kennzeichen "A" versehen. Dort kann er vom Kunden erneut bearbeitet werden. Rückgaben können

- die vollständige Einlieferung einschließlich Einlieferungsauftrag oder
- nur den Einlieferungsauftrag (bei Rückgabe ohne Urkunden)

beinhalten.

25.2.2 Rückgabe von Auslieferungen

Auslieferungen werden, sofern keine Settlementsperre vorhanden ist, bis zu 40 Bankarbeitstage im System vorgetragen. Danach erfolgt eine automatische Löschung. Zusätzlich kann von der CBF auch eine Rückgabe veranlasst werden. Die Aufträge werden in den Erfassungsstatus zurückgestellt.

26 Euro-Umstellung

In Abhängigkeit von der Umstellungsmethode (Bottom-Up/Top-Down), mit der die Umstellung des Depotbestandes einer Gattung vorgenommen wurde, sind bzgl. der Nominalen i.d.R. Alternativ-Eingaben möglich.

- Bei Umstellung durch die Top-Down Methode ist immer die EURO-Nominale einzugeben.
- Erfolgte die Bestandsumstellung durch die Bottom-Up Methode, kann wahlweise die Euro-Nominale oder die Nominale-Urkunde erfasst werden.

Bei Erfassung der Nominale-Urkunde wird die Buchungs-Nominale vom System errechnet. Alternativ ist die Buchungs-Nominale zu erfassen, insbesondere wenn die Bank die Währung der Stückelungen nicht kennt. In diesem Fall wird die Nominale-Urkunde errechnet. In beiden Fällen wird systemseitig auf Darstellbarkeit der kleinsten Stückelung bzw. der kleinsten übertragbaren Einheit geprüft.

26.1 TOP-DOWN mit Eingabe der Nominale in EURO

Kf = Konversionsfaktor = 1,95583 (nur Beispiel)

Umrechnung:

$$\frac{\text{kleinste Stueckelung DM}}{\text{Kf}} = \text{kleinste Einheit EURO}$$

(auf 2 Nachkommastellen gerundet)

$$\frac{\text{Nominale EURO}}{\text{kleinste Einheit EURO}} = \text{Anzahl Stuecke}$$

Ist der Wert in Anzahl Stücke eine ganze Zahl, so ist die Darstellbarkeit gegeben.

Berechnung der Nominale-Urkunde für die Anzeige:

Anzahl Stücke x kleinste Stückelung DM= Nominale-Urkunde DM

Beispiele:

a) Nominale: 5.000 Euro

kleinste Stückelung DM: 100

$$\frac{100}{\text{Kf}} = 51,\dot{1}3 (\text{kleinste Einheit EURO})$$

$$\frac{5000,00\ \text{EURO}}{51,13} = 97,79\ \text{Stuecke}$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt keine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit nicht gegeben.

b) Nominale: 4.959,61 Euro

kleinste Stückelung DM: 100

$$\frac{100}{\text{Kf}} = 51,\dot{1}3 (\text{kleinste Einheit EURO})$$

$$\frac{4959,61\ EURO}{51,13} = 97\ Stuecke$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt eine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit gegeben.

97 x 100 = 9.700 DM →Nominale Urkunde

c) Nominale: 1.549.300.000,- Euro

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{10000\ EURO}{Kf} = 5112,92\ (kleinste\ Einheit\ EURO)$$

$$\frac{1549300000\ EURO}{5112,92} = 303016,67\ Stuecke$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt keine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit nicht gegeben.

d) Nominale: 1.549.296.567 Euro

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{10000\ EURO}{Kf} = 5112,92\ (kleinste\ Einheit\ EURO)$$

$$\frac{1549296567\ EURO}{5112,92} = 303016,0000547632\ Stuecke$$

Die Berechnung der Anzahl der Stücke ergibt keine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit nicht gegeben.

307.933 x 10.000 = 3.079.330.000 DM → Nominale Urkunde

e) Nominale: 1.549.296.566,72Euro

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{10000\ EURO}{Kf} = 5112,92\ (kleinste\ Einheit\ EURO)$$

$$\frac{1549296566,72\ EURO}{5112,92} = 303016\ Stuecke$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt eine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit gegeben.

303.016 x 10.000 = 3.030.160.000 DM → Nominale Urkunde

26.2 BOTTOM-UP mit Eingabe der Nominale in EURO

Umrechnung:

Nominale EURO x Kf = Nominale DM (auf 2 Nachkommastellen gerundet)

Darstellbarkeit:

$$\frac{\text{Nominale DM}}{\text{kleinste Stueckelung DM}} = \text{Anzahl Stuecke (auf Ganze gerundet)}$$

Anzahl Stücke x kleinste Stückelung DM = Nominale-Urkunde

Wenn $\frac{\text{Nominale} - \text{Urkunde}}{\text{Kf}}$, so ist die Nominale EURO darstellbar.

Beispiele:

a) Nominale: 4.980,69 Euro

kleinste Stückelung DM: 100

4.980,69 Euro x Kf = 9.741,3829 DM gerundet auf 9.741,38 DM

$$\frac{9741,38\ \text{DM}}{100} = 97,4138\ \text{(gerundet auf 97 Stueck)}$$

97 x 100 = 9.700 DM → Nominale-Urkunde

Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$4980,69\ \text{EURO} - \frac{9700\ \text{DM}}{\text{Kf}} = 0\ ?$$

4.980,69 Euro – 4.959,53 = 21,16 > 0

Die Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist größer als Null. Deshalb ist eine Darstellbarkeit nicht gegeben.

b) Nominale: 5.061,79 Euro

kleinste Stückelung DM: 100

5.061,79 Euro x Kf = 9.900,0007 DM gerundet auf 9.900,00 DM

$$\frac{9900\ \text{DM}}{100} = 99\ \text{Stueck}$$

99 x 100 = 9.900 DM → Nominale-Urkunde

Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$5061,79\ \text{EURO} - \frac{9900\ \text{DM}}{\text{Kf}} = 0\ ?$$

5.061,79 EURO – 5.061,79 EURO = 0

Die Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist Null. Die Darstellbarkeit ist damit gegeben.

c) Nominale: 1.549.300.224,- Euro

kleinste Stückelung DM: 10.000

1.549.300.224,- Euro x Kf = 3.030.167.857,10592 DM
gerundet auf 3.030.167.857,10DM

$$\frac{3030167857{,}10\ \text{DM}}{10000} = 303016{,}78571 \text{ gerundet auf } 303.016 \text{ Stück}$$

303.016 x 10.000 = 3.030.160.000,- DM → Nominale-Urkunde

Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$1549300224\ \text{EURO} - \frac{3030160000\ \text{DM}}{\text{Kf}} = 0\ ?$$

1.549.300.224 EURO – 1.549.296.206,73= 4017,27 > 0

Die Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist größer als Null. Die Darstellbarkeit ist deshalb nicht gegeben.

d) Nominale: 1.549.296.206,74 Euro

kleinste Stückelung DM: 10.000

1.549.296.206,74 Euro x Kf = 3.030.160.000,03537 DM
gerundet auf 3.030.160.000,04 DM

$$\frac{3030160000{,}04}{10000} = 303016\ \text{Stueck}$$

3303.016 x 10.000 = 3.030.160.000,- DM → Nominale-Urkunde

Prüfung auf Darstellbarkeit:

Kf

3.030.160.000DM

$$1.549.296.206{,}74\ \text{EURO} - \frac{3030160000\ \text{DM}}{\text{Kf}} = 0\ ?$$

→ 1.549.296.206,74 Euro – 1.549.296.206.73= 0,01 > 0

Die berechnete Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist größer als Null. Damit ist eine Darstellbarkeit nicht gegeben.

26.3 BOTTOM-UP mit Eingabe der Nominale Urkunde

Umrechnung:

$$\frac{\text{Nominale} - \text{Urkunde}}{\text{Kf}} = \text{Nominale EURO (auf 2 Nachkommastellen gerundet)}$$

Darstellbarkeit:

$$\frac{\text{Nominale} - \text{Urkunde}}{\text{kleinste Stueckelung DM}} = \text{Anzahl Stuecke}$$

Ist der Wert in Anzahl Stücke eine ganze Zahl, so ist die Darstellbarkeit gegeben.

Beispiele:

a) Nominale-Urkunde: 5000,- DM

kleinste Stückelung DM: 100

$$\frac{5000,00\ \text{DM}}{\text{Kf}} = 2556,46\ \text{EURO} \rightarrow \text{Nominale Euro}$$

Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$\frac{5000,00\ \text{DM}}{100,00\ \text{DM}} = 50\ \text{Stueck}$$

Die Anzahl Stücke ist ganzzahlig, somit ist eine Darstellbarkeit gegeben.

b) Nominale-Urkunde: 3.079.330.000,- DM

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{3079330000,00\ \text{DM}}{\text{Kf}} = 1574436428,52\ \text{EURO} \rightarrow \text{Nominale Euro}$$

Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$\frac{3079330000,00\ \text{DM}}{10000,00\ \text{DM}} = 307933\ \text{Stueck}$$

Die Anzahl Stücke ist eine ganze Zahl, damit ist die Darstellbarkeit gewährleistet.

Leerseite

Glossar

A

Abwicklung Clearstream Banking
Siehe Settlement-Verarbeitung

Aktienbuch
Namensaktien sind unter Angabe des Eigentümers mit Namen und den gesetzlichen Zusätzen in das Aktienbuch der AG einzutragen. Als Aktionär der AG gilt, wer als solcher im Aktienbuch eingetragen ist. Jedem Aktionär ist auf Verlangen Einsicht in das Aktienbuch zu gewähren.

Aktionär
Der Aktionär ist Eigentümer einer Aktie. Namensaktien lauten auf den jeweiligen Inhaber, der im Aktienbuch des Emittenten eingetragen ist.

Aktionärsnummer
Eine Nummer, die zur eindeutigen Identifikation von Aktionären bei den Emittenten (vinkulierter) Namensaktien dient.

Auftrag
In CASCADE wird jede Form der Anweisung eines Kunden an die CBF (z. ëB. jede Einlieferung und Auslieferung, jeder Wertpapier-Übertrag) als Auftrag bezeichnet.

Auftraggeber
Der Auftraggeber eines Wertpapierübertragungsauftrages stellt bei den Stücken die Lastschriftseite eines Auftrages dar, d.h. sein Stücke-Depot wird belastet.

Auftragsart
Feste Form einer Anweisung an die CBF (z. B. Auslieferung, Einlieferung, WP-Übertrag).

Auftragsbestand
Siehe Auftragsstatus.

Auftragsnummer
Die Auftragsnummer, die den Auftrag in CASCADE identifiziert, darf je Eingeber noch nicht im System vorhanden sein. Von den Systemnutzern kann eine 7-stellige Nummer zwischen 1 und 6.999.999 frei vergeben werden. WP-Überträge, die automatisch in CASCADE erzeugt wurden, erhalten vom System eine eigene Nummer zwischen 9.500.000 und 9.999.999 zugewiesen. Automatisch generierte Aufträge aus Umlegungen und Stornos erhalten Auftragsnummern zwischen 8.000.000 und 9.499.999. Die Auftragsnummern zwischen 7.000.000 und 7.999.999 sind für CCP-Aufträge reserviert.

Auftragsreferenz
siehe Auftragsnummer

Auftragsstatus
Nach Erfassung und Kontrolle im Dialog befinden sich die Aufträge im Auftragsstatus, d.h. sie sind rechtsgültig an die CBF erteilt und können verarbeitet werden. Aufträge über DFÜ werden sofort nach technischen Eingangs- und fachlichen Plausibilitätsprüfungen in den Auftragsstatus überführt. Aufträge, die sich im Auftragsstatus befinden, bilden den sog. Auftragsbestand.

Ausbuchung
Vorgang der Depotbestandsveränderung in der Anwendung Kapitaldienste. Aufgrund des Depotbestandes einer WKN/ISIN werden Umsätze der gleichen WKN/ISIN in einem vorgegebenen Verhältnis ausgebucht unter gleichzeitiger Gutschrift/Belastung eines eventuellen Gegenwertes (Ausbuchung von Optionsscheinen nach Ablauf der Optionsfrist).

Auslieferung
Auftragsart; effektive Auslieferung von Wertpapieren.

Auslieferungsauftrag
Auftrag eines Kunden, effektive Stücke zu Lasten des eigenen Wertpapierdepots auszuliefern. Für RS ist ein externer Depotübertrag zu Gunsten des internen Abwicklungskontos bei der CBF notwendig.

B

Banknummer (= Hauptkontonummer)
Für jeden Marktteilnehmer, der die Regularien der CBF für die Einrichtung eines Depotkontos erfüllt, wird eine 4-stellige Banknummer vergeben. Diese Nummer wird auch als Stamm-Nummer oder Stockregister- Nummer bezeichnet. Die erste Stelle identifiziert gleichzeitig die Zuordnung für den Börsenplatz.

Begebung
Siehe Emission.

Begünstigter
Der Begünstigte stellt immer die Gutschriftseite eines Auftrages dar, d.h. er erhält eine Depotgutschrift.

Bestandsführung
Siehe Depotbuchbestand.

Bestandsübertrag
Interner WP-Übertrag für vinkulierte Namensaktien aus dem zugeteilten Bestand eines Wertpapierbesitzers in den freien Meldebestand eines Kunden der CBF.

Bezugsrechte
Das Aktiengesetz schreibt vor, dass bei einer Kapitalerhöhung die jungen Aktien den Aktionären der AG im Verhältnis ihres Anteilsbesitzes zum Erhöhungsbetrag anzubieten sind. Bezugsrechte werden über einen bestimmten Dividendenschein hinterlegt und sind über die Börse handelbar. Verkäufe und Zukäufe von Bezugsrechten können nur innerhalb einer vorgegebenen Frist ausgeführt werden.

Bezugsrechtausübung
Erfolgt nach Maßgabe der im Bezugsangebot bekanntgegebenen Bezugsbedingungen. Im Regelfall wird der Aktionär, der sein Bezugsrecht ausüben will, seine Depotbank beauftragen, die jungen/neuen Aktien zu beziehen. Liegt kein Auftrag zur Ausübung der Bezugsrechte bis zum letzten Handelstag der Bezugsnotierung vor, wird das Recht in der Regel am letzten Handelstag für Rechnung des Aktionärs an der Börse veräußert.

BIC
Bank Identification Code; International genormte eindeutige Kennzeichnung einer Bank.

Bond Stripping

Bond Stripping ermöglicht es, eine Anleihe mit fixen Zinszahlungen in einzelne Strippingkomponenten aufzuteilen und wieder zusammenzuführen. Die Strippingkomponenten sind der Mantel sowie die einzelnen Zinsscheine. Sowohl die Anleihe als auch die Strippingkomponenten können selbständig gehandelt und abgewickelt werden.

Buchungstag
Buchungstag, zu dem Wertpapier- und Geldregulierung tatsächlich durchgeführt werden.

Buchungstextschlüssel
Zugeordneter Buchungsschlüssel zu einer Auftragsart innerhalb der Depot- und Geldabwicklung bei der CBF Inland.

Buchungsvaluta
Siehe Settlement-Day und Buchungstag.

C

CARAD
Central Application für Registration and Administration of Securities Document Numbers (Stückenummernverwaltung); zentrale Speicherung sämtlicher in der Girosammelverwahrung befindlichen Zertifikatsnummern effektiver Stücke. Maschinelle Prüfung ruhender und bewegter Stücke auf Opposition. Durch Feststellung doppelter Nummern in einer Gattung sollen gefälschte Stücke sofort erkannt werden.

CASCADE
Central Application for Settlement Clearing And Depository Expansion; Datenverarbeitungssystem für die beleglose Auftragserteilung an die CBF. Dazu erfolgt die Speicherung der Aufträge in Datenbanken. Zur effizienten Auftragsabwicklung steht ein Paket von Dienstleistungen zur Verfügung.

CBF - Domestic
Clearstream Banking AG Frankfurt (CSD für Deutschland).

CEDEL
Jetzt: Clearstream Banking Luxemburg.

Clearing und Settlement Statement
Neuer Regulierungsdatenträger der CBF (Settlement report).

Coupon
Sammelbezeichnung für die zu einem Wertpapier gehörenden Zins-, Dividenden- und Ertragsscheine, die neben einem eventuellen Erneuerungsschein (Talon) den (Coupon)-Bogen bilden. Der Inhaber des Coupons bezieht auf ihn fällige Zinszahlung, Dividende oder andere Rechte.

CUSIP-Nummer
Committe on Uniform Security Identification Procedures; amerikanische Wertpapierkennnummer

D

Dauer Globalurkunde
Sie repräsentiert für die gesamte Emissionsdauer eine Mehrzahl vertretbarer Einzelrechte in einer Urkunde; der Ausdruck einzelner Urkunden ist auf Dauer der Laufzeit ausgeschlossen.

DEM
ISO-Kürzel für Deutsche Mark noch als Depotwährung möglich.

Depotbank
Bank, die berechtigt ist, die Verwahrung und Verwaltung von Wertpapieren für andere vorzunehmen.

Depotbuch
Siehe Monatskontoblatt

Depotbuchbestand
Der Depotbuchbestand enthält im Buchungssystem der Clearstream Banking nur Wertpapierbestände mit Mitbesitzübergang. Der Mitbesitzübergang findet für die STD-Verarbeitungen direkt statt, für alle SDS-Verarbeitungen abhängig vom Bundesbank-Freigabedienst (etwa gegen 14:00 Uhr) und für RTS-Geschäfte jederzeit während der entsprechenden Verarbeitungszeiten. Die Depotbuchbestände werden 120 Arbeitstage historisch online angezeigt.

Depotbuchung
Der Depotbuchbestand wird durch verschiedene Depotbuchungen verändert. Nach der Bundesbank-Verrechnung findet eine Depotbuchung für Aufträge der SDS-Batchverarbeitungen statt. STD-, RT-STD- und RTS-Depotbuchungen verändern sofort den Depotbuchbestand.

Depotkonto
Bestandskonto bei der CBF, das sich aus Kontonummer und WKN/ISIN zusammensetzt.

Depotübertrag
Interner (nur Kundenreferenzwechsel) oder externer Übertrag (Gutschrift zu Gunsten eines anderen CBF-Kunden) von Wertpapieren eines Kunden in Namensaktien eines Wertpapierbesitzers (Aktionärs).

Depotumsätze
Aufträge werden durch die erfolgreiche Disposition in Depotumsätze umgewandelt.

Depotreferenz
Zweiter Teil der Kundenreferenz.Siehe Kundenreferenz.

DFÜ
Datenfernübertragung (File-Transfer).

Disposition
Siehe Settlement-Verarbeitung

Dispositionsart
Es gibt folgende Dispositionsarten:

- STD mit Batchverarbeitung (Massendisposition) (Valuta heute per morgen, 19:00 Uhr)
- RT-STD mit Continuous Settlement (Sofortdisposition) (Valuta heute, von 01:30 - 05:30 Uhr)
- SDS1 mit Continuous Settlement (Valuta heute, von 05:30 bis 10:00 Uhr),
- SDS1 mit Batchverarbeitung (Valuta heute, 10:00 Uhr),
- SDS2 mit Continuous Settlement (Valuta heute, von 10:30 bis 13:15 Uhr),
- SDS2 mit Batchverarbeitung (Valuta heute, 13:15 Uhr),
- RTS mit Continuous Settlement (Valuta heute, von 07:00 bis 18:00 Uhr, ohne Gegenwertverrechnung),

- RTS mit Continuous Settlement (Valuta heute, von 07:00 bis 16:30 Uhr, mit Gegenwertverrechnung EUR).

Dispositionsbestand
Verfügbarer Depotbestand für die einzelnen Verarbeitungszyklen bei der CBF - Inland. Wird als Grundlage zur Deckungsberechnung herangezogen. Berücksichtigt Depotbuchbestand, Dispositionssaldo und Reservierungen.

Dispositionsmodus
Gibt an, welche Dispositionsverarbeitung für den entsprechenden Auftrag durchgeführt werden soll:

- Disposition Lastschrift- und Gutschriftseite,
- Reservierung Lastschriftseite (Umsatzreservierung),
- Reservierung Gutschriftseite (Guthabenreservierung),
- Rücknahme Reservierung (Umsatz-/Guthabenreservierung)
- Umwandlung Reservierung in Disposition (Umsatzreservierung).

Dispositionspriorität
Reihenfolge der Verarbeitung in einer Batchverarbeitung. Kann vom Eingeber gesteuert werden. Es sind die Werte von 1 bis 5 zulässig, wobei 1 die höchste und 5 die niedrigste Priorität darstellt.

Dispositionssaldo
Ergebnis jeder STD- und SDS-Batch- oder Cont-Verarbeitung. Nachdem der Mitbesitzübergang aufgrund der LZB-Freigabe feststeht, wird der Dispositionssaldo dem bis dahin existierenden Depotbuchbestand je WKN/ISIN hinzugerechnet. Auf diese Art ergibt sich der neue Depotbuchbestand für den nächsten Valutatag.

Dispositionsstatus
Über den Dispositionsstatus werden Informationen zu dem aktuellen Status eines Auftrages weitergegeben, die über eine 3-stelligen Code erkennbar sind. Zum Beispiel wird angezeigt, ob ein Auftrag bereits das Settlement durchlaufen hat bzw. zu welchem Ergebnis diese Verarbeitung geführt hat (Beispiele: abgelehnt wegen fehlenden Bestandes; Disposition erfolgreich durchgeführt; etc.).

Dividende
Der Anteil am Gewinn einer Aktiengesellschaft, der auf eine einzelne Aktie entfällt. Bei Aktien, die pro Stück notiert werden, bezieht sich die Dividende auf das Stück. Die Hauptversammlung beschließt über den Dividendenvorschlag des Vorstandes und Aufsichtsrates.

Dividendenabschlag
Kursminderung bei Aktien, die nach den Dividendenzahlung eintritt. Die Kursnotiz wird am Zahlbarkeitstag mit "ex Div" gekennzeichnet.

E

Eigenbesitz
Aktienerwerber und eingetragener Aktionär sind identisch.

Einbuchung
Vorgang der Depotbestandsveränderung aus der Anwendung Kapitaldienste (KADI). Aufgrund des Depotbuchbestandes einer Wertpapierkennnummer werden Umsätze für eine neue (oder die gleiche) WKN/ISIN im Trennverhältnis (bzw. Einrichtungsverhältnis) je Konto-Nummer gebildet.

Eingeber
Als Eingeber wird grundsätzlich in CASCADE der Auftraggeber eines Auftrages geführt. Wird CBF beauftragt einen Auftrag in das CASCADE-System zu erfassen, wird CBF auch als Eingeber dieses Auftrages hinterlegt.

Einlieferung
Effektive Urkundeneinlieferung eines Kunden bei der CBF zugunsten seines Depots oder einer dritten Depotbank bei der CBF.

Eintragung/Ersteintragung
Die Registrierung eines Wertpapierbesitzers von Namensaktien im Aktienbuch des Emittenten für die im Rahmen einer Kapitalerhöhung ausgegebenen jungen Aktien. Bis zur Bestätigung der Eintragung sind die Aktien nicht handelbar. Nach der Bestätigung werden sie in den Hauptbestand des Aktionärs übertragen.

EM
Siehe Emittent

Emission
Bezeichnung für die Gesamtheit der zu einer Ausgabe gehörenden Wertpapiere.

Emissionseinführung
WP-Übertrag in Namensaktien vom Lead-Manager an eine Depotbank oder von einer Depotbank an eine andere Depotbank.

Emittent
Juristische Person des Privatrechtes (meist AG) oder öffentlich-rechtliche Körperschaft, die Wertpapiere ausgibt.

Emittenten-Datei
Auszug aus dem Aktienbuch des Emittenten zur Prüfung der Zuordnungsnummern und der Aktionärsdaten bei der Einlieferung.

Erstbelieferung
Eine Belieferung nach Erscheinen der Stücke zur Ablösung einer interimistischen Globalurkunde.

Erträgnisse
Siehe Dividende.

Euro
Europäische Währung, gesetzliches Zahlungsmittel. ISO-Abkürzung EUR.

Evidenzstelle = Registered Shares Abwicklung
Stelle der CBF - Inland, die die spezifischen Prüfungen für Namensaktien durchführt. Sie stellt die Verbindungsstelle zwischen den Kunden, den Emittenten und der CBF Abwicklung dar.
Hauptfunktionen sind:

- die Überwachung der technischen Kommunikation mit den Emittenten,
- die Kommunikation mit den Kunden im Falle von Rückfragen zu Vorgängen inkl. Börsengeschäften,
- die Überwachung der zugewiesenen Bestände und des freien Meldebestandes.

F

FMB
Siehe Freier Meldebestand.

Freier Meldebestand
Der freie Meldebestand in RS-Namensaktien dient zur Belieferung und Gutschrift von Geschäften. Die Verfügung aus dem freien Meldebestand ist nicht mit dem Recht auf bestimmte Stücke verbunden. Im freien Meldebestand stimmen, im Gegensatz zum Hauptbestand, wirtschaftlicher Eigentümer und eingetragener Aktionär nicht überein.

Fremdbesitz
Läßt sich ein Treuhänder anstelle des Aktienerwerbers im Aktienregister eintragen, muss dies als Fremdbesitz gekennzeichnet werden.

FT
File-Transfer: Übertragung von Daten im Stapel über Datenleitung (siehe auch DFÜ).

FTB
Fremdtresorbestand: CBF bietet Outsourcern an, deren Tresorbestand bei CBF im sogenannten Fremdtresorbestand in Streifbandverwahrung zu übernehmen.

G

Gesamtemissionsvolumen
Gesamtnominale, mit der ein Wertpapier emittiert wird.

Girosammelverwahrung (GS)
Die CBF ist Sammelverwahrer für die von seinen Depotkunden eingelieferten Wertpapiere. Die Wertpapiere (auch Globalurkunden) werden im Tresor getrennt nach Gattungen verwahrt. Der Kunde erhält infolgedessen nur eine Gutschrift auf einen Anteil am Girosammeldepot. Der Sammelverwahrer verwahrt die Stücke jedoch nicht unter besonderer Bezeichnung der Hinterleger bzw. der als Zwischenverwahrer auftretenden Bank, sondern fügt die Stücke dem befindlichen Sammelbestand der betreffenden Wertpapiergattung bei. Girosammelverwahrung ist die Voraussetzung für den Wertpapiergiroverkehr (Girosammelverkehr).

Globalurkunde (interimistisch)
Die interimistische Globalurkunde bezweckt, vor Ausdruck und Lieferung von Einzelurkunden die amtliche Notierung der Neu-Emission zu ermöglichen. Der Emittent hinterlegt die interimistische Globalurkunde – auf den Gesamtbetrag der Emission lautend – bei der CBF. Diese nimmt sie nur entgegen, wenn der Emittent sich verpflichtet, sie spätestens binnen vier Monaten durch Einzelstücke zu ersetzen, daher die Bezeichnung "interimistisch" (zwischenzeitlich).

GS
Siehe Girosammelverwahrung.

H

Hauptbestand
Bestand in (vinkulierten) RS-Namensaktien, bei dem der wirtschaftliche Eigentümer gleich dem eingetragenen Aktionär ist (siehe Freier Meldebestand).

Hauptkontonummer
Siehe Banknummer

Hauptversammlung
Versammlung der Aktionäre und Organ der Aktiengesellschaft. Jeder Aktionär hat das Recht zur Teilnahme an der Hauptversammlung der AG, deren Aktien er besitzt. Bei (vinkulierten) Namensaktien muss ein Eintrag im Aktienbuch erfolgt sein, bevor das Stimmrecht auf der Hauptversammlung ausgeübt werden kann. Die Hauptversammlung entscheidet u. a. über die Zusammensetzung des Aufsichtsrates und die Verwendung des Bilanzgewinnes.

HB
Siehe Hauptbestand

I

Identifizierendes Merkmal eines Wertpapierbesitzers
Informationen, die der eindeutigen Identifizierung eines Wertpapierbesitzers bei Namensgleichheit dienen. Als identifizierende Daten können Geburtsdatum/Gründerdatum und/oder ein freier Text verwendet werden.

Institutsreferenz
Erster Teil der zweiteiligen Kundenreferenznummer. Siehe Kundenreferenz.

Interner Auftrag
Maschinell erzeugte Aufträge aus Depotveränderungen (Auftragsart 13 aus Kapitaldiensten).

ISIN
(International Standard Identification Number). International anerkannte Kennnummer von Wertpapieren. Von der ISO wurden Regularien aufgestellt, wie die ISIN für Wertpapiere auszusehen hat. Die eigentliche Vergabe dieser Nummern wird von Land zu Land von unterschiedlichen Organisationen durchgeführt. In Deutschland wird diese Aufgabe von den 'Wertpapiermitteilungen' (WM) wahrgenommen.

ISO
International Standard Organisation (DIN).

J

Junge Aktien (Neue Aktien)
Neue Aktien aus der Erhöhung des Grundkapitals. Aktien mit abweichender Dividendenberechtigung bis zur Gleichstellung der alten Aktien.

Jungschein
Der Jungschein ist kein Wertpapier, sondern eine depotrechtliche Verpflichtung. Der Emittent verpflichtet sich durch ein Schreiben, den Jungschein, gegenüber der CBF mit Lieferung von Einzelurkunden bzw. einer Dauer-Globalurkunde auszutauschen.

K

KADI
Kapitaldienste. Ein CBF internes Programmpaket, das alle Dienstleistungen im Zusammenhang mit Zinsen, Dividenden und Rückzahlungen beinhaltet (KADI-Erträgnisse) sowie alle Sonderprogramme zu Kapitalveränderungen, die zu Veränderungen auf Depotkonten oder der Tresorbestände bei CBF führen.

Kann-Feld
Datenfeld für die Auftragsbearbeitung, welches nicht gefüllt sein muss. Wenn gefüllt, erfolgt entsprechende Verarbeitung.

Kapitaldienste
Siehe KADI

Kapitalerhöhung aus Barbezug
Eine Erhöhung des Grundkapitals gegen Einlagen.

Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln
Im Falle einer Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln fließen der AG keine neuen Mittel zu. Vielmehr werden offene Rücklagen in Grundkapital umgewandelt. Die Aktionär erhält neue Aktien, ohne Einzahlungen leisten zu müssen (Berichtigungs-, Aufstockungs-, Gratisaktien).

Kapitalmaßnahmen
Siehe KADI.

Kennnummer für Wertpapiere
Siehe Wertpapier-Kennnummer.

KE-Typ
Identifizierung der bei einer Kapitalerhöhung (KE) in Namensaktien entstehenden Wertpapierbestände bis zur Eintragung im Aktienbuch. Aktien in diesen Beständen können nicht zur Geschäftsabwicklung (börslich sowie außerbörslich) herangezogen werden.

Kleinste handelbare Einheit
Von der Emittentin in den Emissionsbedingungen vorgegebene Mindestnominale für den Handel von Wertpapieren an der Börse. Sie kann von Wertpapier zu Wertpapier unterschiedlich sein.

Kleinste lieferbare Einheit
Von der Emittentin festgelegte kleinste lieferbare Stückelung einer Emission.

Kleinste übertragbare Einheit
Von der Emittentin festgelegte Mindestnominale für die Übertragung von Wertpapieren im Effektengirosystem.

Konto-Stammnummer
Siehe Banknummer.

Kontonummer
Die 7-stellige "Kontonummer" einer Bank bei der CBF setzt sich zusammen aus der 4-stelligen Banknummer und dem 3-stelligen Unterkonto.

Kontrolle
Bestätigung und Freigabe von CASCADE-Aufträgen im Erfassungsstatus zur Überführung in den Auftragsstatus. Diese Kontrollfunktion muss von einem zweiten Bankmitarbeiter (andere User-ID als der Erfasser) wahrgenommen werden. Spezifikation des Original-Auftraggebers oder Endbegünstigten in einem CASCADE-Auftrag.

Kundenreferenznummer Bank
Diese Referenznummer dient der Bank zur eindeutigen Identifizierung der Bestände eines Kunden. Kundenreferenznummer kann z. B. die Nummer eines Depotkontos des Kunden sein.

Um jederzeit feststellen zu können, welche Depotkunden an den erweiterten Beständen für Namensaktien (Registered Shares – RS) partizipieren, müssen die Banken geeignete organisatorische Vorkehrungen in ihrer Bestandsführung treffen, die sich in der Kundenreferenznummer widerspiegeln können.

Kupon
Siehe Coupon.

Kupon-Bogen
Siehe Coupon-Bogen.

KUSTA
Kunden-Stammdatenbank der CBF, Datenbank mit allen erforderlichen Angaben zu Kunden, Börsenteilnehmern, Teilnehmern ausländischer Zentralverwahrer und Clearingorganisationen. Hierin sind die wesentlichen Merkmale zur Kontoführung und Geschäftsabwicklung pro Konto gespeichert.

L

Lagerstelle
Bank im Ausland, bei der die CBF ausländische Original-Aktien verwahren lässt.

LIMA
Link Manager. Die Funktionen des Systems LIMA bieten Service für Kunden, die ein eigenes EDV-System nutzen, um die Auftragserteilung, den Administrations-Informationsaustausch und den Settlement- Informationsaustausch elektronisch (per file-transfer) mit dem System CASCADE auszutauschen.

M

Markierung
Kennzeichnung eines Auftrages zur Änderung oder Löschung. Im Rahmen des Systems CASCADE müssen Aufträge aus dem Auftragsstatus, die geändert oder gelöscht werden sollen, zuerst mit dem Kennzeichen "X" markiert werden. Nach Betätigung von PF3 wird dieser markierte Auftrag in den Erfassungsstatus eingestellt.

Dort kann er dann geändert bzw. über die Funktion Kontrolle direkt gelöscht werden.

Monatskontoblatt
Depotbuch (Umsatzjournal) mit Saldenfortschreibung für einen bestimmen Zeitraum (z. B. Kalendermonat) bei der CBF.

Muss-Feld
Für die Auftragsbearbeitung verarbeitungspflichtiges Datenfeld, welches gefüllt sein muss.

N

Nominalwert
siehe Nominalbetrag

Neu-Emission
Neuzulassung von Wertpapieren in die Girosammelverwahrung.

Neuzulassung
Einlieferung von Globalurkunden, Jungscheinen oder Einzelurkunden zur Verbriefung von Emissionen.

Nominalbetrag
Dieser Betrag stellt den zu buchenden Betrag in einer Gattung dar.

Nominalbetrag Urkunde
Der auf einem Wertpapier aufgedruckte DEM bzw. EUR-Betrag bzw. Stück-Betrag der Wertpapieremission.

O

Optionsscheintrennung
Auftragsart, mit der die Bestandstrennung einer Optionsanleihe cum (WKN/ISIN-Cum) in die Bestände Optionsanleihe-ex (WKN/ISIN-Ex) und nur-Optionsscheine (WKN/ISIN-Opt) vorgenommen wird.

Optionsscheinzusammenführung
Auftragsart, mit der eine Bestandszusammenführung aus den Beständen Optionsanleihe-ex (WKN/ISIN-Ex) und nur-Optionsscheine (WKN/ISIN-Opt) zur Optionsanleihe-cum (WKN/ISIN-Cum) vorgenommen wird.

Operativer RS-Bestand (erweiterte Bestandsführung bei Namensaktien)
Setzt sich zusammen aus dem Hauptbestand, dem zugewiesenen Bestand und dem freien Meldebestand bei Namensaktien.

Opposition
Veröffentlichung der Stückenummern all derjenigen Wertpapiere, die als verloren feststehen oder sonst wie abhanden gekommen sind.

Optionsrecht
Das einer Optionsanleihe anhaftende Recht auf Bezug von Aktien einer AG. Das Optionsrecht kann mit der Anleihe verbunden sein oder als eigenständiges Recht gehandelt werden. Siehe auch Optionsschein/Warrant).

Optionsschein/Warrant
Bei Optionsanleihen ist das Recht auf Ausübung der Option gesondert in Optionsscheinen verbrieft, die zwar zusammen mit Teilschuldverschreibungen der Anleihe ausgegeben werden, aber selbständige Rechte beinhalten. Daher werden die Optionsscheine an der Börse gehandelt und können amtlich notiert werden.

Optionsschuldverschreibung (-Anleihe, -Obligation)
Schuldverschreibung, die dem Inhaber neben der Verzinsung das Recht einräumt, Aktien der emittierenden AG zu einem bestimmten Kurs (Optionskurs) innerhalb einer festgelegten Frist (Optionsfrist) zu beziehen. Nach Ausübung der Option bleibt die Schuldverschreibung, im Gegensatz zur Wandelschuldverschreibung, bestehen, d. h. der Ausübende erwirbt die Aktien zusätzlich. Die Ausgabe von Optionsschuldverschreibungen wird insbesondere durch die Möglichkeit der bedingten Kapitalerhöhung erleichtert. Wenn das Optionsrecht getrennt von der Aktie gehandelt wird, erfolgen i. d. R. drei Notierungen: für volle Stücke (cum Optionsrecht), für leere Stücke (ex Optionsrecht) sowie für das Optionsrecht selbst (Warrant).

P

Pflege
Erfassung, Änderung und Löschung von Daten in einer EDV-Anwendung.

Plausibilitätsprüfung
Prüfung von Bedingungen in einer Software.

Primanote
Ordnungsnummer (Sammelnummer) für interne Zusammenfassung mehrerer Aufträge bei dem Kunden der CBF.

Q

Query
Maschinelle Anfrage im Rahmen des Informationsdienstes CASCADE-LIMA zu Aufträgen eines Kunden.

R

Rahmenvertrag
Vertrag zwischen der CBF und seiner Kunden zur Regelung der Einlieferung effektiver Stücke in Namensaktien zum Umtausch in Mitbesitzanteile an einer technischen Rahmenurkunde (BIS-ZU) mit der Zulassung dieser Gattungen in die Girosammelverwahrung. Der Abschluss des Vertrages ermöglicht die elektronische (stückelose) Einlieferung von Namensaktien (RS).

Real-Time-Settlement (= RTS)
Bei Aufträgen, die im Real-Time-Settlement reguliert werden, findet ein sofortiger Übergang des Mitbesitzes der Wertpapiere statt. Die Geldverrechnung wird über einen direkten Weg mit der LZB vorgenommen, d.h. sie findet außerhalb des täglichen Nettings der DM-Salden statt. Der Käufer muss den Gegenwert auftragsbezogen über das ELS-System der LZB auf das dortige Konto der CBF überweisen.

Registered Shares Abwicklung (RS)
Unit der CBF - Inland, die die spezifischen Prüfungen für Namensaktien durchführt. Sie stellt die Verbindungsstelle zwischen den Kunden, den Emittenten und der CBF dar. Sie nimmt hauptsächlich folgenden Funktionen wahr:

- die Überwachung der technischen Kommunikation mit den Emittenten,
- die Kommunikation mit den Kunden im Falle von Rückfragen zu Vorgängen inkl. Börsengeschäften,
- die Überwachung der zugewiesenen Bestände und des freien Meldebestandes.

Regulierungsdatenträger jetzt Clearing and Settlement Statement
Medium, das Informationen der gebuchten Aufträgen eines Kontos an den Kunden innerhalb des Settlements der CBF übermittelt.

RS
Registered Shares = Namensaktien

RS Disposition
Prozess, der die spezifischen Aufträge für die GS-Abwicklung von Namensaktien disponiert.

RTS
Real-Time-Settlement. Siehe Real-Time-Settlement.

Rücktausch
Auftragsart, mit dem Anteile an einem Inhabersammelzertifikat der CBF in Original Aktien bei der entsprechenden Lagerstelle rückgetauscht werden.

S

Same-Day-Settlement
Wertpapier- und Geldregulierung am Tag der Auftragserteilung. Mitbesitzübergang erfolgt nach Bestätigung durch die LZB.

SDS
Same-Day-Settlement. Siehe Same-Day-Settlement

Serie/Litera
Die Angabe einer Serie/Litera ist stückelungsbezogen, nicht stückenummernbezogen. Serien/Litera gelten im Verbund mit der Stückenummer.

Settlementverarbeitung
Bei jedem zu verarbeitenden Auftrag findet für die betroffene Gattung eine Prüfung auf ausreichenden Wertpapierbestand unter anschließender Veränderung der Dispositionssalden dieser Gattung statt. Bestandsübertragungen werden mehrmals am Tage vorgenommen. Eine Prioritätensteuerung der zu verarbeitenden Aufträge durch die auftraggebende Seite ist möglich. Eine eigene Geldverarbeitung findet bei der Abwicklung nur als Geldausgleich zur täglichen LZB-Verrechnung statt (Nettingverfahren).

Settlement-Art
Art der Regulierung eines Auftrags im CASCADE-Systems: Standard- und SDS-Settlement, SDS-Sofort- Verarbeitung oder Real-Time-Settlement. Elektronische Einlieferungen für effektive Urkunden werden grundsätzlich mit der Settlement-Art Real-Time-Settlement (RTS) gebucht.

Settlement-Day
Vorgegebener Buchungstag, zu dem Wertpapier- und Geldregulierung erfolgen sollen.

Sofortdisposition
(Continuous Settlement) Sofortige Stücke-Verarbeitung. Dies ist arbeitstäglich von 07:00 bis 10:00 Uhr in CASCADE möglich. Die bei Aufträgen mit DEM-Gegenwert notwendige Geldverrechnung findet im Rahmen der täglichen LZB-Verrechnung statt.

Stamm-Nummer (SM)
Eine Gattung wird in der Stamm-Nummer gehandelt, die Lieferung der Stücke erfolgt in Serien/Gruppen. Die Aufteilung in die entsprechenden Serien/Gruppen erfolgt vor Tilgungsbeginn auf die Buchbestände der CBF gemäß den vorhandenen Tresorbeständen in den eintsprechenden Serie/Gruppen. Die Einlieferungen von effektiven Urkunden bei der CBF erfolgt nach Aufteilung der Gattung in einzelnen Serien/Gruppen unter der WKN/ISIN der Serie/Gruppe.

Standard-Settlement
Wertpapier-Batchverarbeitung "heute Valuta morgen" (= STD-Verarbeitung).

STR
= Streifbandverwahrung. In der Börsengeschäftsabwicklung mögliche Verwahrart. Über die CBF erfolgt nur die Gegenwertverrechnung. Die effektiven Stücke sind direkt vom Verkäufer an den Käufer zu liefern.

Strip-Aufteilung
Auftragsart, mit der eine Cum-Anleihe in die Strippingkomponenten Mantel und einzelne Zinsscheine getrennt wird.

Strip-Zusammenführung
Auftragsart, mit der die Strippingkomponenten Mantel und einzelne Zinsscheine zur Cum-Anleihe zusammengeführt werden.

Stücke
Wertpapiere, zugleich Mengenbezeichnung für Wertpapiere.

Stückelung
Unter Stückelung versteht man die Aufteilung einer Emission in mehrere Nennbeträge. Bezogen auf ein Wertpapier gibt die Stückelung an, wieviel Grundeinheiten der betreffenden Gattung in der jeweiligen Urkunde verbrieft sind.

Stückelungstausch
Stückelungstausch kann durch Einlieferung eines Kunden und unter gleichzeitiger Auslieferung innerhalb einer Gattung vorgenommen werden. Bei Namensaktien (RS) wird der Tausch von Zuordnungsnummern zwischen zugeteilten Beständen und freiem Marktbestand, falls bei der Durchführung eines Bestandsübertrags keine passenden Stückelungen in dem zu übertragenden Bestand gefunden wurden, automatisch durchgeführt. Es wird für die Restmenge automatisch eine Umschreibung generiert und durchgeführt.

Stückezuteilungsalgorithmus
Verfahren zur Zuteilung von Stücken beim Aktienumtausch.

Stückenummer
Ein eindeutiges Bezeichnungsmerkmal einer physischen Wertpapierurkunde.

SWIFT
Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication S. C. in La Hulpe, Belgien

T

Technische Globalurkunde
Die technische Globalurkunde will den Ausdruck von Einzelstücken einschränken. Sie verkörpert damit den "Bodensatz" der Bestände, der stets in den Tresoren der CBF verbleibt. Die technischen Globalurkunden entsprechen den Richtlinien zur Lieferbarkeit, da sie jederzeit gegen auszudruckende Einzelurkunden austauschbar sein müssen. Aus ihnen ist erkennbar, welche Anzahl und Stückelung von Einzelurkunden sie verbriefen. Wenn die gedruckten Stücke nicht ausreichen, muss die technische Globalurkunde ganz oder zum Teil in Einzelurkunden umgetauscht werden.

Technische Globalurkunde - BIS- ZU
Eine Globalurkunde, die Ansprüche auf girosammelverwahrte Namensaktien (z. B. nach Ausübung von Bezugsrechten) bis zur Eintragung des Inhabers solcher Ansprüche in das Aktienbuch des Emittenten verbrieft. Nach seiner Eintragung hält der Aktionär einen entsprechenden Miteigentumsanteil an der bei der CBF eingerichteten variablen Globalurkunde, in der alle girosammelverwahrten Namensaktien verbrieft sind.

Teilrecht
Entfällt bei einer Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln auf einen Anteil am bisherigen Grundkapital der AG nur ein Teil einer neuen Aktie, sind die entstandenen Teilrechte, die meist auf einen besonders dafür bestimmten Gewinnanteilschein ausgegeben werden, getrennt lieferbar. Die Inhaber der Teilrechte können diese veräußern oder weitere Teilrechte zur Darstellung eines handelbaren Stückes erwerben.

Textschlüssel
Zugeordneter Buchungsschlüssel zu einer Auftragsart im CASCADE Abwicklungssystem der CBF.

U

Umtausch
Auftragsart, mit der ein Tausch von bestimmten Aktien bei der entsprechenden Lagerstelle der CBF in Anteile an dem Inhabersammelzertifikat bei der CBF vorgenommen wird.

Umschreibung
Eine Umschreibung ist notwendig, wenn der wirtschaftliche Besitzer nicht mit dem im Aktienbuch des Emittenten eingetragenen Aktionär übereinstimmt. Eine vom Emittenten bestätigte Umschreibung bewirkt den Übergang der umgeschriebenen Aktien vom zugewiesenen Bestand in den Hauptbestand.

V

Valutierung einer Globalurkunde
Mit dieser Auftragsart im Wertebereich kann die Hochschreibung einer Globalurkunde BIS-ZU durch den Lead-Manager veranlasst werden.

Verknüpfung
Aufgrund bestimmter Vorgänge, wie z. B. Optionsscheintrennung, können Verknüpfungen zwischen Umsätzen entstehen. Diese Verknüpfungen können innerhalb einer WKN/ISIN auftreten oder auch WKN/ISIN-übergreifend sein. Für die Verarbeitung innerhalb der Disposition muss berücksichtigt werden, ob die Ablehnung eines Umsatzes die Ablehnung aller mit diesem verknüpften Umsätze nach sich zieht, oder ob diese Umsätze trotz Verknüpfung getrennt verarbeitet werden können.

Verwahrart
Das Kennzeichen steuert die Abwicklung in Abhängigkeit von der Form, in der ein Wertpapier gelagert wird. Mögliche Kennzeichen für Verwahrart im Lieferbestand: GS, STR, AKV, WPR. Die Verwahrarten AKV und WPR weisen darauf hin, dass die Stücke im Ausland verwahrt werden und von der CBF bzw. einer inländischen Bank Guthaben in Wertpapierrechnung erteilt wird.

Vier-Augen-Prinzip
Erfassung und Kontrolle von Daten müssen beim Vier-Augen-Prinzip von zwei verschiedenen Personen vorgenommen werden. Das System prüft die Identifikation von Erfasser und Kontrolleur über die jeweiligen Benutzerkennungen (USER-IDs).

VNA
(Vinkulierte) Namensaktien jetzt RS – registered shares.

Vormänner-Haftung
Bei teileingezahlten Aktien bleibt bis zu zwei Jahren nach Umschreibung der Altaktionär (Vormann) in Haftung, wenn der ihm folgende Eigentümer der Aktien eine Nachzahlung verweigert.

W

Währung
Währung, in der Gegenwerte aus WP-Überträgen und Börsengeschäften reguliert werden können.

Wertpapierbesitzer
Besitzer von Wertpapieren. Wertpapierbesitzer von Namensaktien können entweder als Aktionär im Aktienbuch eingetragen sein oder die Eintragung wurde mittels Umschreibung für ihre Aktien beantragt, so dass sie bis zur Bestätigung der Umschreibung nur wirtschaftliche Rechte geltend machen können.

Wertpapierkennnummer
In Deutschland eine numerische Bezeichnung (ab 2003 alphanumerisch) mit sechs Stellen, die Wertpapiergattungen zugeordnet werden; dienen der Erleichterung des Wertpapierverkehrs. Die CBF führt bis zum Jahr 2003 durchgängig die internationale Wertpapier-Kennnummer ISIN ein. Siehe ISIN.

Wertpapierübertragungs-Auftrag
Anweisung des Depotkunden an die CBF, eine Übertragung mit/ohne Gegenwertverrechnung von Wertpapieren auszuführen.

WKN
Abkürzung für Wertpapierkennnummer. Siehe Wertpapierkennnummer oder ISIN.

WKN-Familie
Zusammenfassung aller Emissionen eines Emittenten in RS-Aktien gemäß im Aktienbuch.

WSS
Wertpapier-Service-System der Deutsche Börse AG. Es werden dort Online-Informationen zu Wertpapier- Stamm- und -Termindaten angeboten; Pflege erfolgt durch WM (Wertpapiermitteilungen).

Z

Zahlstelle
Der Emittent bzw. dessen Lead-Manager muss im Emissionsprospekt Zahlstellen angeben, d. h. Banken, bei denen Zins- und Dividendenscheine, ausgeloste oder gekündigte Schuldverschreibungen usw. eingelöst werden können bzw. entsprechende Zusatzrechte gegen Vorlage von Kupons bzw. Urkunden angefordert werden können.

Zielreferenz
Zwischenkonto bei der empfangenden Bank bei dem Erhalt eines externen Depotübertrags.

ZMB
Zugewiesener Meldebestand.

Zugeteilter Bestand
Summe aus Hauptbestand und zugewiesenem Meldebestand eines Wertpapierbesitzers.

Zuordnungsnummer
Die Zuordnungsnummer entspricht der Stücknummer, sie darf bei GS-verwahrten Namensaktien jedoch nicht als solche bezeichnet werden, da die effektiven Urkunden vernichtet wurden und der Aktionär nur noch ein quotenmäßiges anteiliges Miteigentum an den sammelverwahrten Wertpapieren hat. Daher kommt dieser Zuordnung keine rechtliche, sondern nur eine registertechnische Bedeutung zu.

Zusatzrecht
Zusatzrechte sind Rechte, die bei einer Kapitalveränderung entstehen und im Rahmen des Depotverwaltungsdienstes der CBF in den Depotbestand des berechtigten Kunden eingerichtet werden.

Zuweisung
Übertragung von Aktien vom freien Meldebestand in den zugewiesenen Bestand eines einzutragenden Wertpapierbesitzers für die anschließende Umschreibung bzw. Ersteintragung.

Zugewiesener Meldebestand
Bestand, in den die umzuschreibenden bzw. einzutragenden Aktien bis zur Bestätigung der Umschreibung des Emittenten separiert werden.

Leerseite

Anhang 1: Transaktionscodes und die zugehörigen Funktionscodes

Als Überblick werden in diesem Kapitel alle möglichen Transactionscodes mit den dazugehörigen Funktionscodes des Wertebereiches aufgelistet, In der ersten Spalte sind die Transaktionscodes aufgeführt, in der zweiten Spalte werden die dazugehörigen Funktionscodes genannt, und in der dritten Spalte wird eine kurze verbale Erläuterung gegeben. Die Transaktions-/Funktionscodes des Girobereiches entnehmen Sie bitte dem Anhang des CASCADE Handbuchs Band 2.

Clearing und Settlement/Custody

CASCADE-Erfassungsstatus

TRAN	FC	Bedeutung
KVEW	**Erfassung Wertebereich**	
KVEW	EL	Laufende Einlieferung (Einzelurkunden und techn.Sammelurkunden)
	NV	Neuzulassung/Valutierung (Globalurkunden/Jungscheine/ Rahmenurkunden)
	AL	Auslieferung
	EF	Einlieferung Kundentresor (nur Outsourcer-Kunden)
	AF	Auslieferung Kundentresor (nur Outsourcer-Kunden)
KVEB	**Änderung/Löschung Wertebereich**	
KVEB	AN	Änderung eines Auftrages
	AF	Änderung fehlerhafter Aufträge
	LN	Löschung eines Auftrages
	LF	Löschung fehlerhafter Aufträge
KVEC	**Kontrolle Wertebereich**	
KVEC	Vollanzeige	
	VA	Kontrolle aller Aufträge
	VN	Kontrolle eines Auftrages mit Auftrags-Nummer
	VP	Kontrolle aller Aufträge mit Primanoten-Nummer
	VL	Kontrolle aller Aufträge mit Lastschrift-Bank
	VG	Kontrolle aller Aufträge mit Gutschrift-Bank
	Tabellarische Kurzanzeige	
	TA	Kontrolle aller Aufträge

TRAN	FC	Bedeutung
	TN	Kontrolle eines Auftrages mit Auftrags-Nummer
	TP	Kontrolle aller Aufträge mit Primanoten-Nummer
	TL	Kontrolle aller Aufträge mit Lastschrift-Bank
	TG	Kontrolle aller Aufträge mit Gutschrift-Bank
KVEI	**Information/online Druck Wertebereich**	
KVEI	AA	Anzeige aller Aufträge
	AF	Anzeige aller fehlerhaften Aufträge
	NR	Anzeige eines Auftrages mit Auftrags-Nummer
	PN	Anzeige aller Aufträge mit Primanoten-Nummer
	LK	Anzeige aller Aufträge mit Lastschrift-Bank
	GK	Anzeige aller Aufträge mit Gutschrift-Bank

Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse)

AUFTRAGSART

Feldname: AA/URSPR AUFTRAGSART

BESCHREIBUNG
Unter Auftragsart versteht man eine feste Form einer Anweisung an den Kassenverein, z. B. eine Auslieferung.

Feldinhalt	Text	Bedeutung
01	WP-UEBERTRAG	Wertpapier-Übertrag mit und ohne Gegenwertverrechnung
02	MATCH-INSTR	Match-Instruktion
03	SV-UEBERTRAG	BSV/LSV-Übertrag
04	VERPFAENDUNG	Verpfändung
05	FREIGABE	Freigabe von Verpfändungen/Sicherheiten
07	UMTAUSCH	Umtausch GBC
09	RUECKTAUSCH	Rücktausch GBC
10	LIEFERBESTAND	Lieferbestand (Börsengeschäfte)
11	WP-LEIHE	Wertpapierleihe-Auftrag
12	WPL-RUECKFUEH	Wertpapierleihe-Rückführung
13	KADI-SONDPRO	Umsatz aus Kapitaldienste-Sondpro
14	STRIP-AUFTEILUNG	Trennung einer Cum-Anleihe in Mantel und einzelne Zinsscheine
15	STRIP-ZUSAMMENFUHERUNG	Zusammenführung von Mantel und einzelnen Zinsscheinen zur Cum-Anleihe
16	EINLIEFERUNG	Einlieferung
17	OPTIONSSCHEIN- TRENNUNG	Trennung von cum-Optionsanleihen in Ex-Anleihe und nur Optionsschein
18	AUSLIEFERUNG	Auslieferung
19	OPTIONSSCHEIN-ZUSAMMENFUEHRUNG	Zusammenführung von Ex-Optionsanleihe und Optionsschein in cum-Optionsanleihe
99	STORNO-NACHB	Storno/Nachbuchung Depot (nur CBF erlaubt)

BEARBEITUNGSSTATUS AUSLIEFERUNG

Feldname: Bearb-Status

BESCHREIBUNG
Die Ausprägungen des Bearbeitungsstatus spiegeln den aktuellen Erfassungsstand der Bank und nach der Kontrolle durch die Bank den aktuellen "Stand" der Aufträge in den Clearing-Prüfstellen wider.

Feldinhalt	Text
10	AUSLIEFERUNG NICHT VOLLSTAENDIG ERFASST
100	AUSLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST
150	AUSLIEFERUNGSAUFTRAG KONTROLLIERT
200	AUSLIEFERUNG IN KPZS VOLLSTAENDIG GEAENDERT
210	AUSLIEFERUNG IN KPZS ZUR RUECKGABE GENERIERT
220	BUCHUNGSFREIGABE IN KPZS ZURUECKGENOMMEN
300	AUSLIEFERUNG IN KPST VOLLSTAENDIG GEAENDERT
310	AUSLIEFERUNG IN KPST ZUR RUECKGABE GENERIERT
320	BUCHUNGSFREIGABE IN KPST ZURUECKGENOMMEN
400	AUSLIEFERUNG ZUR BUCHUNG FREIGEGEBEN
410	ABGELEHNT IN DISPOSITION/ZURUECK IN KPZS
500	AUSLIEFERUNG ZUR BUCHUNG FREIGEGEBEN
510	ABGELEHNT IN DISPOSITION/ZURUECK IN KPST
590	AUFTRAG ERFOLGREICH GEBUCHT
600	AUSTRAGUNG DER AUSLIEFERUNG AUS CARAD BESTAETIGT
610	AUSLIEFERUNG GELOESCHT
620	MANUELLE ZUWEISUNG UNVOLLSTAENDIG
630	MANUELLE ZUWEISUNG VOLLSTAENDIG
640	ABGELEHNT IN MASCHINELLER ZUWEISUNG
650	AUSLIEFERUNG STORNIERT
700	ALLE SENDUNGEN DURCH EFFEKTEN-AUSGANG AUSGELIEFERT
701	NOCH TEILSENDUNGEN OFFEN
702	ALLE SENDUNGEN AUSGELIEFERT, AUFTRAG IST ZU LOESCHEN
703	ZUWEISUNG ABGESCHLOSSEN
720	VOM E-AUSGANG ZURUECKGEN. - MASCH. ZUWEISUNG ZURUECKGENOM.
730	VOM E-AUSGANG ZURUECKGEN. - MAN. ZUWEISUNG NOCH VORHANDEN
750	KEINE AUSLIEFERUNG DURCH EFFEKTEN-AUSGANG ERFORDERLICH
790	AUSLIEFERUNG DURCH EFFEKTEN-AUSGANG GEAENDERT
791	ENDBEARBEITETE AUSLIEFERUNG DURCH EFFEKTEN-AUSGANG GEAENDERT
792	HISTORISCHE AUSLIEFERUNG IN KPHI GEAENDERT
993	UMLEGUNG AUTOMATISCH ENDBEARBEITET
999	LOESCHUNG WG. REDENOMINATION

BEARBEITUNGSSTATUS EINLIEFERUNG

Feldname: Bearb-Status

BESCHREIBUNG
Der Bearbeitungsstatus informiert über den aktuellen 'Zustand' des Einlieferungsauftrages bei der CBF.

Feldinhalt	Text
10	EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU WENIG STUECKE
30	EINL. Z. RUECKGABE GENERIERT, ZU WENIG STUECKE
50	EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU VIELE STUECKE
70	EINL. Z. RUECKGABE GENERIERT, ZU VIELE STUECKE
100	EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST
150	EINLIEFERUNG ZUR RUECKGABE GENERIERT
200	EINLIEFERUNG ANGENOMMEN
410	EINLIEFERUNG GEAENDERT - ZU WENIGE STUECKE
450	EINLIEFERUNG GEAENDERT - ZU VIELE STUECKE
500	EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG GEAENDERT
522	BUCHUNGSFREIGABE ONLINE ZURUECKGENOMMEN
523	BUCHUNGSFREIGABE ZURUECKGENOMMEN, INKONSISTENZEN MIT CARAD
700	EINLIEFERUNG ZUR BUCHUNG FREIGEGEBEN
701	ZUSTIMMUNG ZUR EINLIEFERUNG ERTEILT
800	AUFTRAG ERFOLGREICH GEBUCHT – UM-/FESTSCHREIBUNG AUSSTEHEND
801	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT NICHT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR
802	BOGENTRESOR HAT NICHT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR
803	MANTEL-/UNIKATE- UND BOGENTRESOR HABEN NICHT VEREINNAHMT
811	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT VEREINNAHMT, BOGENTRESOR NICHT
812	BOGENTRESOR HAT VEREINNAHMT, MANTEL/UNIKATETRESOR NICHT
821	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR
822	BOGENTRESOR HAT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR
823	MANTEL-/UNIKATETRESOR UND BOGENTRESOR HABEN VEREINNAHMT
911	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT GELOESCHT, BOGENTRESOR NICHT
912	BOGENTRESOR HAT GELOESCHT, MANTEL-/UNIKATETRESOR NICHT
921	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT GELOESCHT, KEIN GEGENTRESOR
922	BOGENTRESOR HAT GELOESCHT, KEIN GEGENTRESOR
923	MANTEL-/UNIKATETRESOR UND BOGENTRESOR HABEN GELOESCHT
931	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT STORNIERT, BOGENTRESOR NICHT
932	BOGENTRESOR HAT STORNIERT, MANTEL-/UNIKATETRESOR NICHT
941	MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT STORNIERT, KEIN GEGENTRESOR
942	BOGENTRESOR HAT STORNIERT, KEIN GEGENTRESOR
943	MANTEL-/UNIKATETRESOR UND BOGENTRESOR HABEN STORNIERT
990	AUFTRAG ENDBEARBEITET

Feldinhalt	Text
991	LOESCHUNG WG. KADI AUF CARAD
999	LOESCHUNG WG. REDENOMINATION

BESONDERHEIT

Feldname: Besonderheit

BESCHREIBUNG
Dieses Kennzeichen dient zur Angabe einer abweichenden Urkundenausstattung für die WKN.

Feldinhalt	Bedeutung
1	NORMALER BLOCK
2	BOGENLOS
3	NUR MANTEL, KEIN BOGENAUSDRUCK
4	EINZELURKUNDE, MANTEL/GLOBALBOGEN
5	MANTEL, BOGEN, ZESSION
6	MANTEL, TALON, ZESSION
7	BLOCK MANUELL ERFASST
8	BLOCK AUS HANDBESTAND
9	EINZELURKUNDE, GLOBALMANTEL/EINZELBOGEN
11	ALTE URKUNDEN
14	M + B GETRENNT
15	NUR MANTEL
16	UNIKAT
17	UNITS
18	CF- UND K-STUKKEN
19	CF-STUKKEN
20	TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (MAN.ERST.)
21	TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (MAN.ERST.)
22	TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (LIEFERBAR)
23	TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (LIEFERBAR)
24	MIT BOGEN
25	OHNE BOGEN
26	JGS OHNE BOGEN
27	FESTSCHREIBUNG
28	NUR BOGEN
29	MANTEL,ZESSION
30	BOGEN, ZESSION
31	MANTEL,BOGEN,ZESSION,ABTRETUNG(en)
32	MANTEL,ZESSION,ABTRETUNG(EN)
33	BOGEN,ZESSION,ABTRETUNG(EN)

Feldinhalt	Bedeutung
34	ZESSION,ABTRETUNG(EN)
35	ZESSION
36	ABTRETUNG(EN)
37	MIT GEWINNANTEILSSCHEIN
38	MÖGLICHER BEZUG VON URKUNDEN
39	KEIN ZINSEN-/DIVIDENTENDIENST
40	KEIN ZINSSCHEIN / TALON
41	NUR TALON
47	IGL MIT BOGEN
48	IGL OHNE BOGEN
49	JUNGSCHEIN MIT BOGEN
50	NICHT VALUTIERT
52	DAUERGLOBALURKUNDE MIT BOGEN
53	DAUERGLOBALURKUNDE OHNE BOGEN
54	RAHMENURKUNDE MIT BOGEN
55	RAHMENURKUNDE OHNE BOGEN
56	GLOBALBONDS MIT BOGEN
57	GLOBALBONDS OHNE BOGEN
97	UMDEUTUNG GU/RU
98	UMDEUTUNG WG: 670

KENNZEICHEN BESTAND

Feldname: KZ-BST

BESCHREIBUNG
Dieses Kennzeichen benennt die erweiterte Bestandsart bei RS, in die die Wertpapiere gebucht werden sollen.

Feldinhalt	Text
HB	Hauptbestand
FM	Freier Meldebestand

EINLIEFERUNGS-ART

Feldname: EINLIEF-ART

BESCHREIBUNG
Angabe über die Art des Auftrages

Feldinhalt	Text	Bedeutung
1	LFD. EINLIEFERUNG	Laufende Einlieferung
2	NEUZULASSUNG GLOBAL	Neuzulassung Globalurkunde
3	NEUZULASSUNG RU	Neuzulassung Rahmenurkunde
4	NEUZULASSUNG VAL. RU	Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde
5	VALUTIERUNG	Valutierung

EINLIEFERUNGS-GRUND

Feldname: EINLIEF-GRUND

Beschreibung
Grund für die Einlieferung

Feldinhalt	Beschreibung
001	aus Emission
002	KE gegen Einlage
003	Kapitalerhöhung bedingt – Optionsscheinausübung-
004	Rahmenurkunde Ersteinlieferung RS
005	Urkundenumtausch
007	Gratisaktien KE-unbedingt
008	Sperre, Revalutierung möglich
010	Direktbelieferung

UMLEGUNG-KZ

Feldname: UMLEGUNG

Beschreibung
Grund für die Umlegung

KZ	Erläuterung
1	VL IN GS
2	GS IN VL
3	GS IN FTB
4	FTB IN GS
5	FTB IN FTB
6	UMLEGUNG RU

KONTROLLKENNZEICHEN (BEARBEITUNGSZUSTAND)

Feldname: KONTROLLKENNZEICHEN/KZ

BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen gibt an, ob und um welche Art von generiertem Auftrag es sich handelt.

Es ist unerheblich, ob ein im Auftragsstatus zur Änderung markierter und daraufhin im Erfassungsstatus generierter Auftrag tatsächlich geändert wird oder nicht. In der Kontrolle wird darauf keine Rücksicht genommen, d. h. ein im Erfassungsstatus zur Änderung generierter Auftrag kann ohne Änderung wieder in den Auftragsstatus gelangen.

Feldinhalt	Bedeutung
" "	Auftrag ist nicht generiert
"A"	Auftrag wurde aus dem Auftragsstatus zur Änderung in den Erfassungsstatus generiert
"L"	Auftrag wurde aus dem Auftragsstatus zur Löschung in den Erfassungsstatus generiert oder Rücknahme Match-Auftrag/Match-Instruktion

KONTROLL-STATUS

Feldname: KONTROLLKENNZEICHEN/KZ

BESCHREIBUNG
Dieses Kennzeichen beinhaltet den momentanen Status des Auftrages bezüglich Kontrolle/Fehler.

Feldinhalt	Bedeutung
" "	Auftrag noch nicht bearbeitet
F	Auftrag fehlerhaft
K	Auftrag kontrolliert

Mangel

Feldname: MANGEL

BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen identifiziert ein Mangelstück (Ausprägungen ab 50) oder kennzeichnet eine oppositionsbelegte Stückenummer (Ausprägungen 0 bis 49).

WSS-KZ	WM-KZ	Mangelgrund
OPPOSITION		
0		Keine Angabe
1	A	Aufgebot
2	B	Aufgebot, Zahlungssperre
3	C	Kraftloserklärung Aufgebot
4	D	Diebstahl/Raub
5	F	aus ausländischer Oppositionsliste
7	K	Kraftloserklärung Aktiengesellschaft
8	L	Aufhebung einer Verlustmeldung
9	M	Aufhebung eines Aufgebots
10	N	Aufhebung einer Zahlungssperre
11	O	Aufhebung eines Aufgebots und einer Zahlungssperre
12	T	Totalfälschung möglich
13	V	Verlust ohne Angabe
14	X	Verlust auf dem Postweg
15	Z	Zahlungssperre
16	W	Verlust
17	U	Totalfälschung möglich
18	P	Aufgebot
19	Y	Zahlungssperre
20	Q	Aufgebot/Zahlungssperre - Umtausch
21	R	Kraftloserklärung, Aufgebot
22	S	Aufhebung eines Aufgebots und einer Zahlungssperre
24	G	aus ausländischer Oppositionsliste
25	E	siehe Textinfo
26	H	Kraftloserklärung nach ausländischem Recht
27	J	Kraftloserklärung nach ausländischem Recht (Ersatzurkunden sind ausgestellt, Stückenummern bleiben gesperrt)
28	I	Aufgebotsfrist abgelaufen, kein Ausschlussurteil (Stückenummern bleiben gesperrt)
29	1	Übernahme in neue ISIN/WKN
MANGEL		
51		Alturkunden mit Litera
52		Verletzung verwahrungstechnischer Angaben
53		Verletzung von Kontroll- oder Treuhänderunterschriften
54		Kupon-Beschädigung

WSS-KZ	WM-KZ	Mangelgrund
55		Nicht lieferbare Urkunden w/Einlieferung zu Gunsten ausl. Sammelverwahrer
56		Roll Over mit Stempel
57		Versiegelt oder verplompt
58		Geheftet
61		Kupongroße Ausstanzungen
62		Abrisse und Ausrisse, soweit die Guillochen verletzt sind
63		Einrisse und Einschnitte, die über die Mitte des Stückes hinausgehen
64		Reservierte Urkunden
70		nicht zumutbare Lieferung
71		Mantel abweichende Stückenummer
72		Bogen abweichende Stückenummer
81		Mantel effektiv/Bogen global
82		Mantel global/Bogen effektiv
83		Haftungserklärung Einlieferer
91		Haftungserklärung CBF

NACHWEISART

Feldname: Nachweisart

Kennzeichen, in welcher Form die Urkunden bei der CBF eingeliefert werden.

Feldinhalt	Text	Bedeutung
01	EINLIEFERUNG EFFEKTIVER URKUNDEN	Einlieferung effektiver Urkunden
02	URKUNDEN LIEGEN BEREITS VOR	Urkunden liegen bereits vor
03	URK. VON DRUCK./EM.	Urkunde von Druckerei oder Emittent
04	EINLIEFERUNG MIT RAHMENVERTRAG	Einlieferung ohne Urkunden
05	EINLIEFERUNG EFFEKTIVER URKUNDEN VORGESEHEN UND ZESSION	Einlieferung effektiver Urkunden vorgesehen und Zession
06	UM-/FESTSCHREIBUNG	Zession liegt wegen Um-/ Festschreibung noch nicht vor
07	ZESSION FEHLT	Zession liegt nicht vor
08	EINLIEF EDT	Einlieferung im EDT-Verfahren

SETTLEMENT-ART

Feldname: SET-ART/SET

BESCHREIBUNG
Dieses Kennzeichen gibt die verschiedenen Arten des Settlements eines Auftrages an.

Feldinhalt	Text	Bedeutung
2	SDS/MAS	SDS-Batchverarbeitung (Massendisposition)
3	STD/MAS	STD-Batchverarbeitung
4	SDS/SOF	SDS-Continuous Settlement (Sofortdisposition)
5	RTS/SOF	RTS-Continuous Settlement

Anhang 3: Tabellen (Berechtigungsprüfung)

Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung

Valutierungen und Revalutierungen ohne Auslieferung Rahmenurkunde von Gattungen mit folgender Wertpapiergruppe (G06) werden mittels einer automatischen Berechtigungsprüfung und einer automatischen Buchungsfreigabe bearbeitet:

Instrument type GD198C (GF1)	Beschreibung
2001	Anleihen (Obligationen, Schuldverschreibungen, Bonds, Notes)
2002	Kassenobligationen
2003	Pfandbriefe
2004	European Covered Bonds
2005	Schatzanweisungen
2006	Finanzierungs-Schätze
2007	Bundesschatzbriefe Typ A
2008	Trust Preferred Securities (TPS)/Renten
2009	Bundesschatzbriefe Typ B
2010	Fundierungsschuldverschreibungen
2011	Certificates of Deposit
2012	Gewinnobligationen
2021	Linked Bonds (sonstige)
2022	Inflation Linked
2031	Anleihen mit Andienungsrecht
2032	Tagesanleihen
2201	Asset Backed Securities
2202	Asset Backed Commercial Papers
2203	Commercial Papers
2204	Credit Linked Notes
2205	Mortgage Backed Securities
2206	Collateral Debt Obligation
2207	Synthetische Collateral Debt Obligation
2208	Synthetische Mortgage Backed Securities
2209	Synthetische Asset Backed Securities
2210	Loan Participation Notes
2701	Wandelanleihe/Convertible
2702	Wandelanleihe/Convertible cum Optionsschein
2703	Wandelanleihe/Convertible ex Optionsschein
2711	Optionsanleihe cum Optionsschein
2712	Optionsanleihe ex Optionsschein
2801	Anleihen mit zertifikatsähnlicher Struktur

Instrument type GD198C (GF1)	Beschreibung
2803	Pfandbriefe mit zertifikatsähnlicher Struktur
2805	Verzinsliche Schatzanweisungen mit zertifikatsähnlicher Struktur
2811	Certificates of Deposit mit zertifikatsähnlicher Struktur
2821	Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur
2822	Inflation Linked mit zertifikatsähnlicher Struktur
2892	An.zert.-ähn.Str.MRZ←80%
2893	Pf.zert.-ähn.Str.MRZ←80%
2894	Schatzanweisungen mit zertifikatsähnlicher Struktur und Mindestrückzahlung von weniger als 80% des eingesetzten Kapitals (Grundlage Emissionskurs)
2895	CD zert.-ähn.Str.MRZ←80%
2896	LB zert.-ähn.Str.MRZ←80%
2897	UA zert.-ähn.Str.MRZ←80%
3001	Warrants
3101	Covered Warrants
4001	Zertifikate auf Wertpapiere
4002	Zertifikate auf Indizes
4003	Zertifikate auf Rohstoffe
4004	Zertifikate auf Währungen
4005	Zertifikate auf Zinssätze
4006	Zertifikate auf sonstige Werte
4007	Zertifikate auf Futures
5001	Wertpapierfonds
5002	Immobilienfonds
5003	Indexfonds
5004	Terminmarktfonds
5005	Sonstige Anlagefonds
5006	Hedgefonds
5007	Altersvorsorgefonds
5011	Gemischte Wertpapier- und Immobilienfonds
5012	Beteiligungsfonds
6111	Genussrechte/Genussscheine

Definition der nicht zugelassenen Gattungen

Folgende Instrumenten-Arten (GD198C) obliegen nicht den automatisch zu verarbeitenden Gattungen (gemäß obiger Definition).

Instrument type GD198C (GF1)	Beschreibung
6005	Droit de Vote
7001	Futures
7501	Options
7601	Basis Trade
7801	Option/Option
7802	Future/Future
7803	Product Spread
8011	Commercial Paper Pro
8012	Commercial Paper MTN
8021	Medium-Term Note Pro
8041	Spezifische Programm
8103	Dummy-WKN tech.Werte
8105	Dummy-WKN Basisw.WMI
8201	Durchschn.Kurse Dep.
8202	Durchschn.Zinssätze
8301	synth. Rente/Anleihe
8401	Geldmarkt-Satz
8501	Swap-Satz
8601	Maß-Einheit
8603	Ausgleichsfaktor
8604	Differenzbetrag
8701	Aktien-Index
8702	Renten-Index
8704	Währungs-Index
8705	Edelmetall-Index
8706	Sonstiger Index
8707	Fonds-Index
8708	Volatilitäts-Index
8709	Commodity-Index
8710	Geldmarkt-Index
8711	Div.-Index
8801	Aktien-Basket
8802	Renten-Basket
8806	Sonstiger Basket
8807	Index-Basket
8808	Invest.Ant. Basket

Instrument type GD198C (GF1)	Beschreibung
8809	Commodity-Basket
9101	Strom
9701	Währungen
9801	Cross Rates

Anhang 4: Tabellen (Buchungstextschlüssel)

BUCHUNGS-TEXT-SCHLÜSSEL-TABELLE - DEPOTBUCHHALTUNG

Textschlüssel	Bedeutung
01	WP-Übertrag ohne Gegenwert - Bank-Erfassung
02	WP-Übertrag ohne Gegenwert - CBF-Erfassung
03	Auslieferung
05	Verpfändung/Freigabe
06	WP-Übertrag mit Gegenwert Bank-Erfassung
08	Einbuchung einer Reservierung zugunsten des Unterkontos/995
09	WP-Übertrag mit Gegenwert CBF-Erfassung
10	Einbuchung aufgrund von Beständen (aus Kapitaldienste)
12	Rückzahlung (aus Kapitaldienste)
13	Split (aus Kapitaldienste)
14	Ausgleich (aus Kapitaldienste)
15	Berichtigungsaktien (aus Kapitaldienste)
16	Umbuchung (aus Kapitaldienste)
17	Umstellung (aus Kapitaldienste)
18	Aktienumtausch (aus Kapitaldienste)
19	Änderung der Verbriefungsart/Jungschein-Auflösung (aus Kapitaldienste)
20	Gesamt-Depot-Übertrag
22	DTCC-Überträge ohne Gegenwert
24	Bondstripping-Trennung
25	Bondstripping-Zusammenführung
26	Optionsscheintrennung
27	Optionsscheinzusammenführung
30	Einlieferung
31	Altsparer-Entschädigung
33	Rücktausch GBC
34	Umtausch GBC
35	WP-Leihe
36	WP-Leihe Rückübertragung
37	Redenomination Ausbuchen (EURO)
38	Redenomination Einbuchen (EURO)
39	Ausgleichsbuchung ohne Gegenwert (automatischer WP-Übertrag ohne Gegenwert)
41	GS-Börse
42	STR-Börse
43	WPR-Börse

Textschlüssel	Bedeutung
44	AKV-Börse
50	Eurex
97	Rücknahme der Reservierungsbuchung (RTS)
99	Storno

BUCHUNGS-TEXT-SCHLÜSSEL-TABELLE - DEM-GELDBUCHHALTUNG

Textschlüssel	Bedeutung
46	Depotgebühren CBF-Ausland
47	Umsatzgebühren CBF-Ausland
48	Transaktions- und DFÜ-Gebühren CBF-Ausland
49	Sonstige Gebühren CBF-Ausland
50	Eurex – Geldumsätze Kapitaldienste
51	Landeszentralbank Zahlungen
52	Postbank Zahlungen
53	BHF-Bank-Giro Zahlungen
54	Saldo aus CBF-Regulierung 1
55	Makler-Courtage
56	Dividenden/Zinsen aus offenen Börsengeschäften
57	Erträgnisse WP-Leihe
58	Saldo aus CBF-Regulierung 2
59	Kursdifferenz-Abrechnung
60	Gegenwert aus Einziehungsverkehr
61	KADI - Dividenden/Zinsen
62	KADI - Kapitalrückzahlungen
63	KADI - Inkasso-Provision
65	LZB-Erhebung CBF
66	LZB-Vergütung CBF
68	Sonstige Gebühren/Versandgebühren
69	Transaktionsgebühren CBF-Inland
70	DFÜ-Gebühren CBF-Inland
71	Depotgebühren CBF-Inland
72	Depotgebühren-Rückvergütung
73	Umsatzgebühren CBF-Inland
74	Gebühren im Auslandsgeschäft (GBC)
75	Gebühren im Treuhandgeschäft (GBC)
76	Gebühren
78	Gebühren gemäß besonderer Aufgabe (DBS-Börsengebühren)
79	Belastung gemäß besonderer Aufgabe
80	Gutschrift gemäß besonderer Aufgabe
81	Gebühren WP-Leihe
82	Gebühren aus BOSS-CUBE
85	Sonstige Gebühren
90	Kontenausgleich Fremdwährung
99	Berichtigungen/Storno

Leerseite

Kontakt

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Clearstream Banking AG, Frankfurt
Mergenthalerallee 61
D - 65760 Eschborn
Deutschland

Postanschrift
Clearstream Banking AG, Frankfurt
D - 60485 Frankfurt/Main
Deutschland

März 2015

Dokumentnummer: F-CON04